TFL
Trade for living

آکادمی ترید برای زندگی

دوره فوتون

Photon Trading FX

مترجم: علی اکبری

@TFLACADEMY

اردیبهشت ۱۴۰۱

«افشای ریسک»

بازارهای مالی (فارکس، کالا، سهام، شاخص‌ها، کریپتو و غیره) بخصوص ابزارهایی که در آن‌ها از اهرم استفاده می‌شود دارای ریسک بالایی هستند و معامله در آن‌ها می‌تواند منجر به ضرر سنگین و یا از دست دادن کل سرمایه درگیر شما شود.

بنابراین با آگاهی و مهارت بالا اقدام به هر گونه تصمیم‌گیری نمایید.

«سلب مسئولیت»

محتوایی که در این کانال مشاهده می‌کنید جنبه آموزشی دارد و پیشنهادی برای سرمایه‌گذاری از سوی مدیران این کانال نیست.

بنابراین مسئولیت هر گونه تصمیمی که اتخاذ نمایید بر عهده شخص شماست.

همچنین این کانال مسئولیتی در قبال محتوای آموزشی و رفتار سایر کانال‌های فعال در این حوزه ندارد و معرفی برخی محتوای مفید آن‌ها به معنای تایید یا رد کلیت فعالیت آن‌ها نمی‌باشد.

فهرست مطالب

فصل اول:

ساختار بازار

مبانی ساختار بازار

✓ **ساختار بازار صعودی یا بولیش (روند صعودی)[۱] ← سقف‌های بالاتر و کف‌های بالاترِ متوالی**

✓ **ساختار بازار نزولی یا بِریش (روند نزولی)[۲] ← سقف‌های پایین‌تر و کف‌های پایین‌ترِ متوالی**

کف‌های بالاتر و سقف‌های پایین‌تر زمانی تایید می‌شوند که یک شکست ساختار (BOS) رخ دهد.

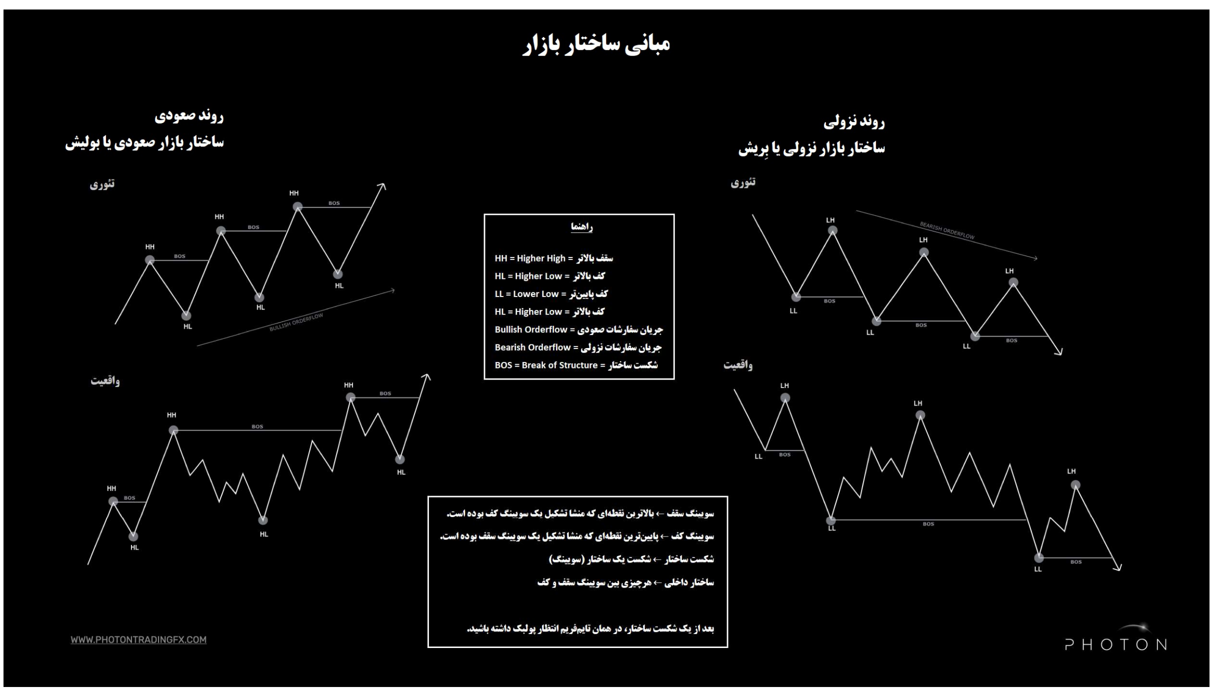
✓ **سوییینگ سقف[۳] ← بالاترین نقطه‌ای که منشا تشکیل یک سوییینگ کف بوده است.**

✓ **سوییینگ کف[۴] ← پایین‌ترین نقطه‌ای که منشا تشکیل یک سوییینگ سقف بوده است.**

✓ **شکست ساختار[۵] ← شکست یک ساختار (سوییینگ)**

بعد از یک شکست ساختار، در همان تایم‌فریم انتظار پولبک داشته باشید.

✓ **ساختار داخلی[۶] ← هر ساختاری بین سوییینگ کف و سقف، ساختار داخلی محسوب می‌شود.**



---

۱ Bullish market structure (Up trend)
۲ Bearish market structure (Down Trend)
۳ Swing High
۴ Swing Low
۵ Break of structure
۶ Internal structure

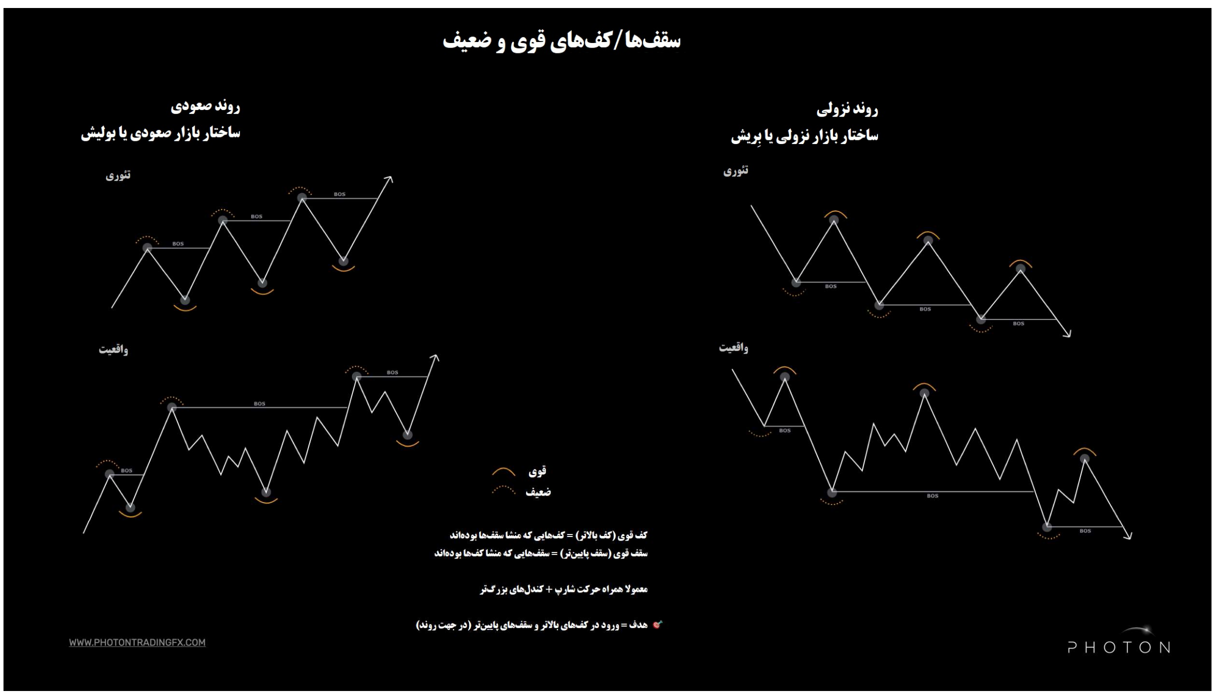
سقف‌ها/کف‌های قوی و ضعیف

- ✓ **سقف‌های قوی (سقف‌های پایین‌تر) ← سقف‌هایی که منجر به تشکیل کف‌ها شده‌اند (منشا حرکت بوده‌اند).**
- ✓ **کف‌های قوی (کف‌های بالاتر) ← کف‌هایی که منجر به تشکیل سقف‌ها شده‌اند (منشا حرکت بوده‌اند).**

معمولا همراه با حرکت شارپ (با مومنتوم) + کندل‌ها بزرگ هستند.

پول‌های بزرگ (بانک‌ها و موسسات) تمایل به محافظت از این سقف‌ها و کف‌های قوی دارند.

هدف = ورود در کف‌های بالاتر و سقف‌های پایین‌تر (در جهت روند) به هدف سقف‌های بالاتر و کف‌هایی پایین‌تر (ساختار ضعیف).



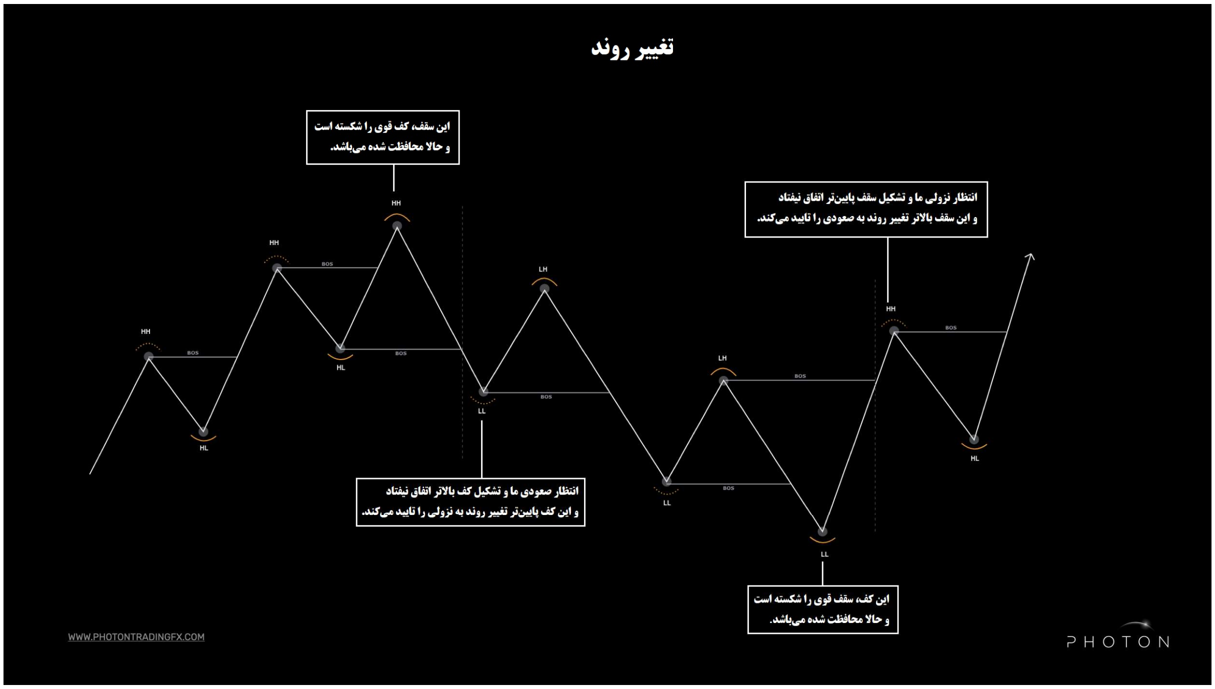
تغییر روند

تغییر روند زمانی است که جریان سفارشات مورد انتظار[۱] ما رخ نمی‌دهد.

در یک روند صعودی، انتظار ما این است که قیمت به ساختن سقف‌ها و کف‌های بالاترِ متوالی ادامه دهد.

در یک روند نزولی، انتظار ما این است که قیمت به ساختن سقف‌ها و کف‌های پایین‌ترِ متوالی ادامه دهد.

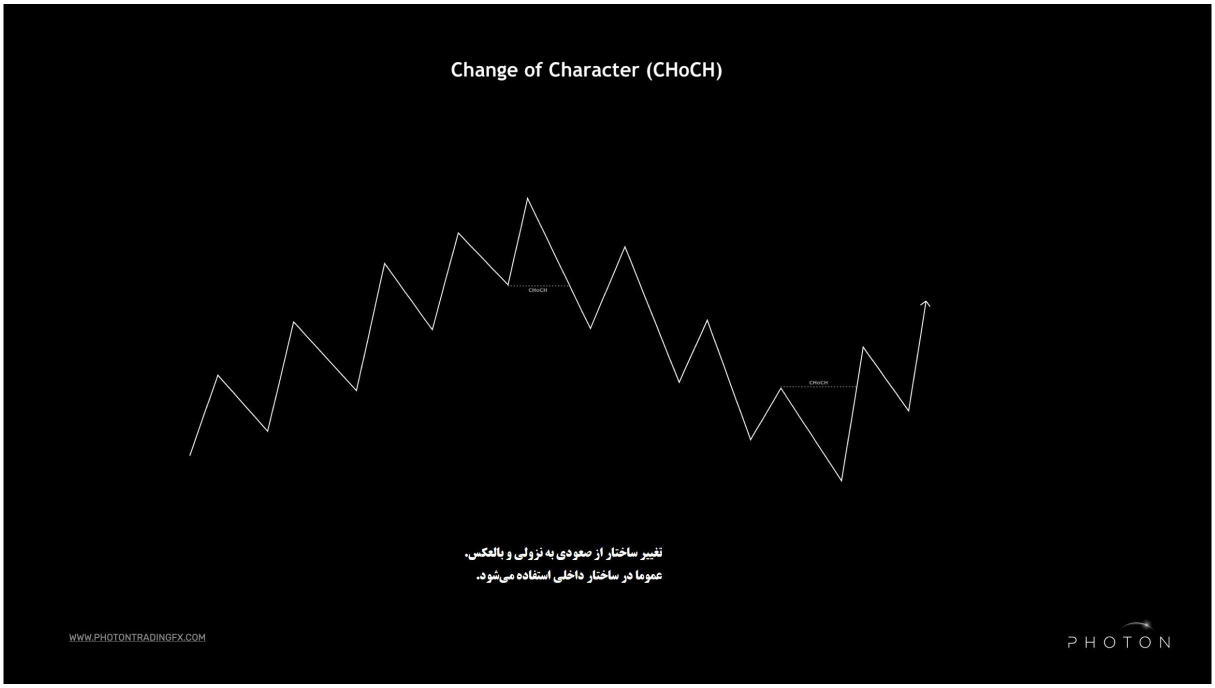
- ✓ **تغییر روند به صعودی ← زمانی که قیمت یک سوییینگِ سقفِ پایین‌تر را می‌شکند تا یک سوییینگ سقف بالاتر بسازد (شکست ساختار صعودی).**
- ✓ **تغییر روند به نزولی ← زمانی که قیمت یک سوییینگ کف بالاتر را می‌شکند تا یک سوییینگ کف پایین‌تر بسازد (شکست ساختار نزولی).**



[۱] Expectational orderflow (EOF)

تغییر ماهیت یا Change of Character (CHoCH)

- ✓ ساختار داخلی ← هر ساختاری بین سوییبنگ سقف و کف
- ✓ تغییر ماهیت (CHoCH) ← تغییر ساختار داخلی از صعودی به نزولی و بالعکس.
- ✓ تغییر ماهیت نزولی ← اولین کف پایین‌تر داخلی بعد از یک سری کف‌های بالاتر داخلی.
- ✓ تغییر ماهیت صعودی ← اولین سقف بالاتر داخلی بعد از یک سری سقف‌های پایین‌تر داخلی.



تغییر ماهیت ادامه‌دهنده روند

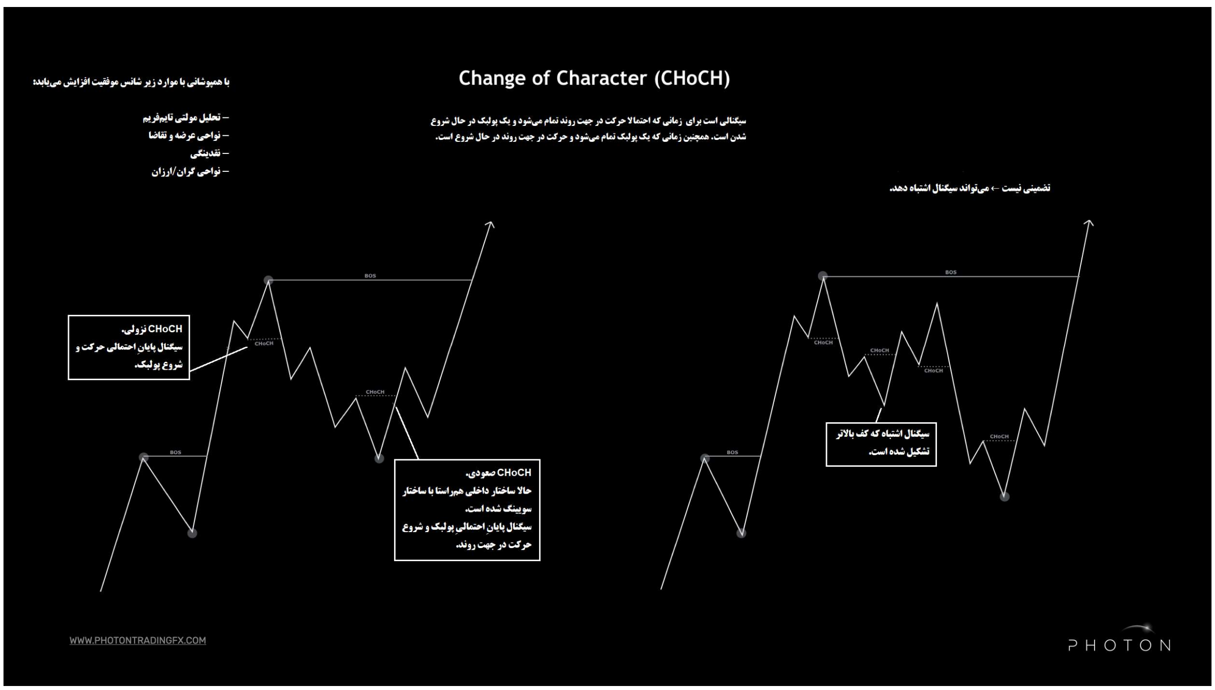
CHoCH یک سیگنال کاربردی برای شناسایی موارد زیر است:

- زمانی که احتمالا یک سویینگِ در جهت روند تمام می‌شود و یک سویینگ پولبک در حال شکل‌گیری است.
- زمانی که احتمالا یک سویینگِ پولبک تمام می‌شود و یک سویینگ در جهت روند در حال شکل‌گیری است.

به بیان ساده‌تر، سیگنالِ CHoCH زمانی که یک نقطه چرخشِ سویینگ در حال شکل‌گیری است به کار می‌رود.

اما CHoCH می‌تواند سیگنال اشتباه دهد، تضمینی نمی‌دهد که یک سویینگِ کف بالاتر یا سقف پایین‌تر تشکیل شده باشد (ممکن است پولبک تمام نشده باشد).

توجه داشته باشید که یک سویینگ کف بالاتر یا سقف پایین‌تر زمانی تایید می‌شود که یک شکست ساختار (BOS) رخ دهد.



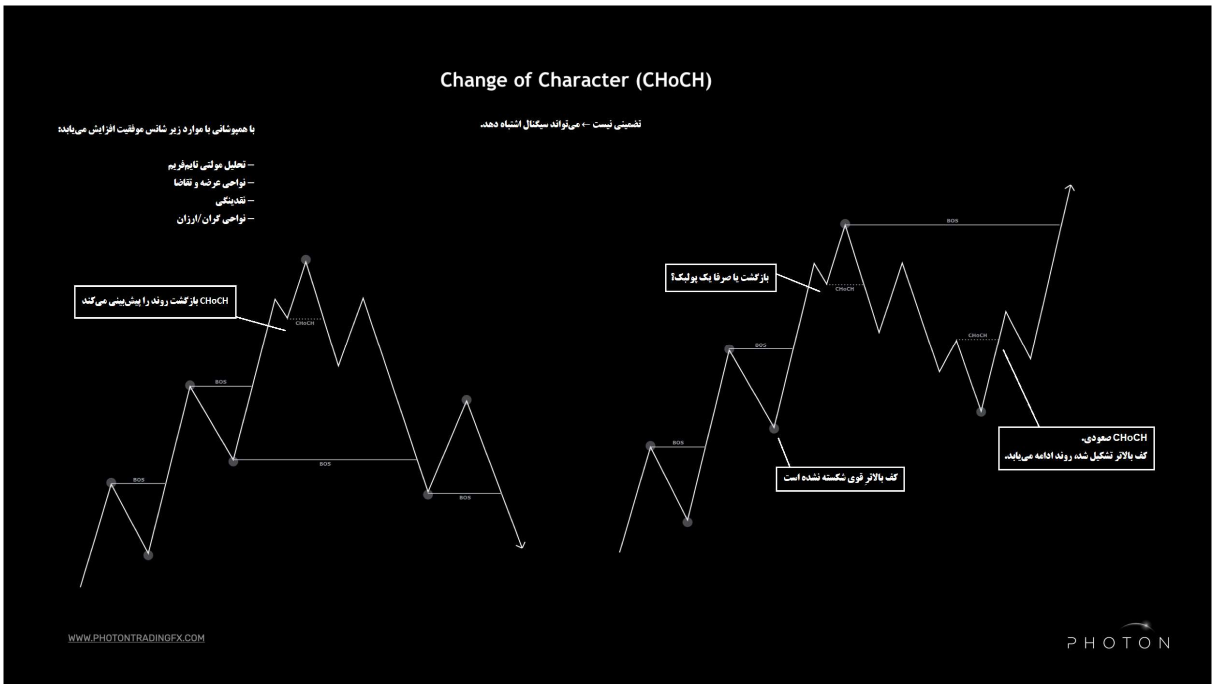
تغییر ماهیت بازگشتی

یک تغییر در روند سویینگ تنها زمانی تایید می‌شود که یک سویینگِ کف بالاتر یا یک سقف پایین‌تر شکسته شود (شکست ساختار یا BOS رخ دهد).

اما CHoCH می‌تواند پیش از شکست ساختار یک سیگنال زودهنگام از تشکیل احتمالی سویینگِ بازگشتی ارائه دهد.

اگرچه که می‌تواند سیگنال اشتباه دهد و کف/سقف بالاتر قوی قیمت را نگه دارد و روند سویینگ ادامه یابد.

توجه داشته باشید که ما چشم بسته انتظار داریم تا روند ادامه یابد تا زمانی که نقض شود (ما همیشه فرض می‌کنیم که سقف/کف‌های قوی قیمت را نگه خواهند داشت و شکسته نخواهند شد تا زمانی که شکسته شوند).



روش‌های مشخص کردن ساختار[1]

✓ **نوع اول (محتاطانه):**

مشخص کردن ← توسط سایه‌ها

شکست ساختار ← توسط بدنه کندل‌ها

من همیشه از این روش برای تعیین شکست ساختار استفاده می‌کنم (شکسته شدن ساختار سویینگ).

✓ **نوع دوم (تهاجمی):**

مشخص کردن ← توسط سایه‌ها

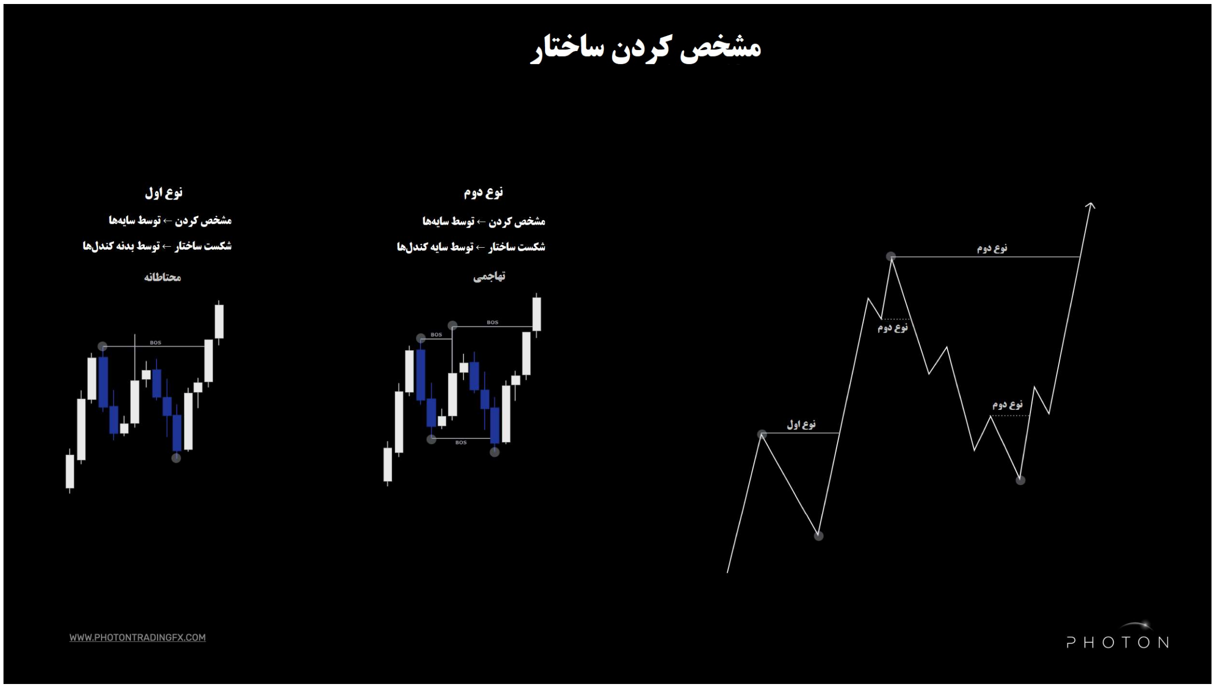
شکست ساختار ← توسط سایه کندل‌ها

من همیشه از این روش برای تعیین CHoCH استفاده می‌کنم (شکسته شدن ساختار داخلی).

نوع دوم تهاجمی‌تر است چون شکست توسط سایه کندل می‌تواند صرفا یک جمع‌آوری نقدینگی باشد. بسته شدن کندل بالا/پایین یک سطح ساختاری بسیار با اهمیت‌تر است.

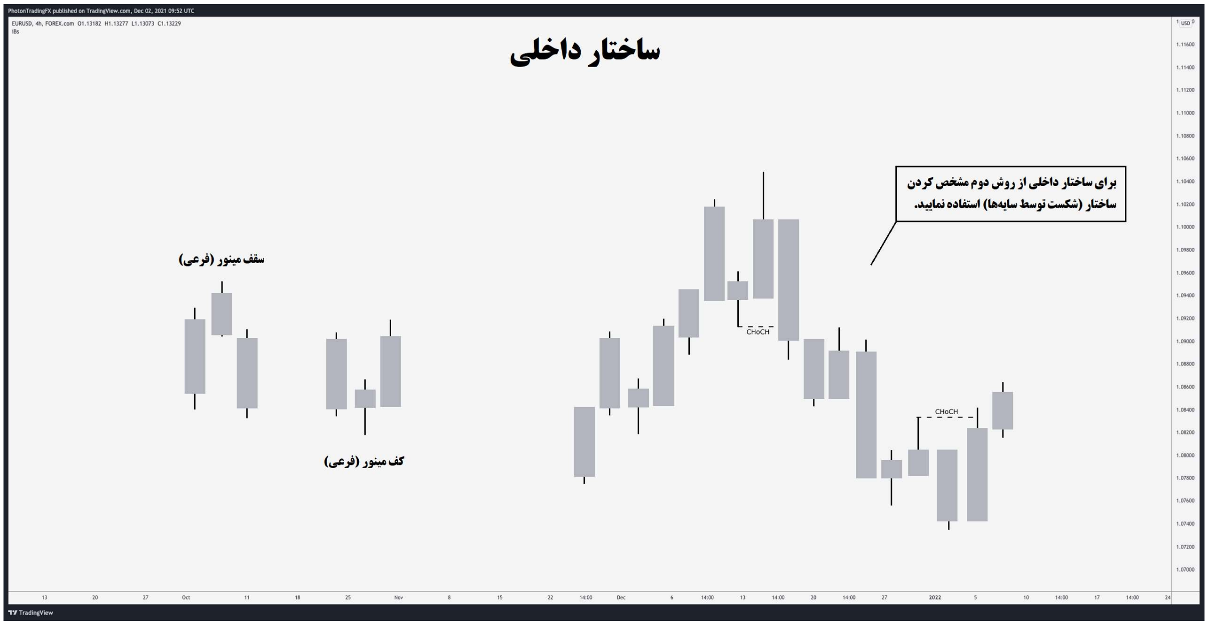
مشخص کردن CHoCH داخلی با روش دوم به احتمال زیاد در یک تایم‌فریم پایین‌تر یک شکست ساختار سویینگ باشد (یک شکست توسط سایه در تایم‌فریم ۴ ساعته به احتمال زیاد یک شکست توسط بدنه در تایم‌فریم ۱۵ دقیقه باشد). این روش تهاجمی است اما چیزی است که ما در تایم‌فریم فعلی می‌بینیم، بدون اینکه تایم‌فریم پایین‌تر را نگاه کنیم.

[1] Structure mapping


مشخص کردن ساختار
نوع اول
مشخص کردن ← توسط سایه‌ها
شکست ساختار ← توسط بدنه کندل‌ها
محتاطانه
BOS
نوع دوم
مشخص کردن ← توسط سایه‌ها
شکست ساختار ← توسط سایه کندل‌ها
تهاجمی
BOS
BOS
BOS
نوع دوم
نوع دوم
نوع اول
نوع دوم
WWW.PHOTONTRADINGFX.COM
PHOTON

مشخص کردن ساختار داخلی و CHoCH به صورت مکانیکی

هر ساختاری که بین سویینگ سقف و سویینگ کف باشد ساختار داخلی محسوب می‌شود. برای مشخص کردن ساختار داخلی از روش دوم (شکست توسط سایه‌ها) استفاده می‌کنیم.



زمانی که ساختار داخلی صعودی است:

- یک سقف داخلی زمانی تایید می‌شود که کندل بعدی نتواند سقف کندل قبل را بشکند (پولبک داخلی).
- یک کف بالاتر داخلی زمانی تایید می‌شود که قیمت سقف داخلی را بشکند (همیشه **نزدیک‌ترین** کف داخلی را مشخص کنید).

زمانی که ساختار داخلی نزولی است:

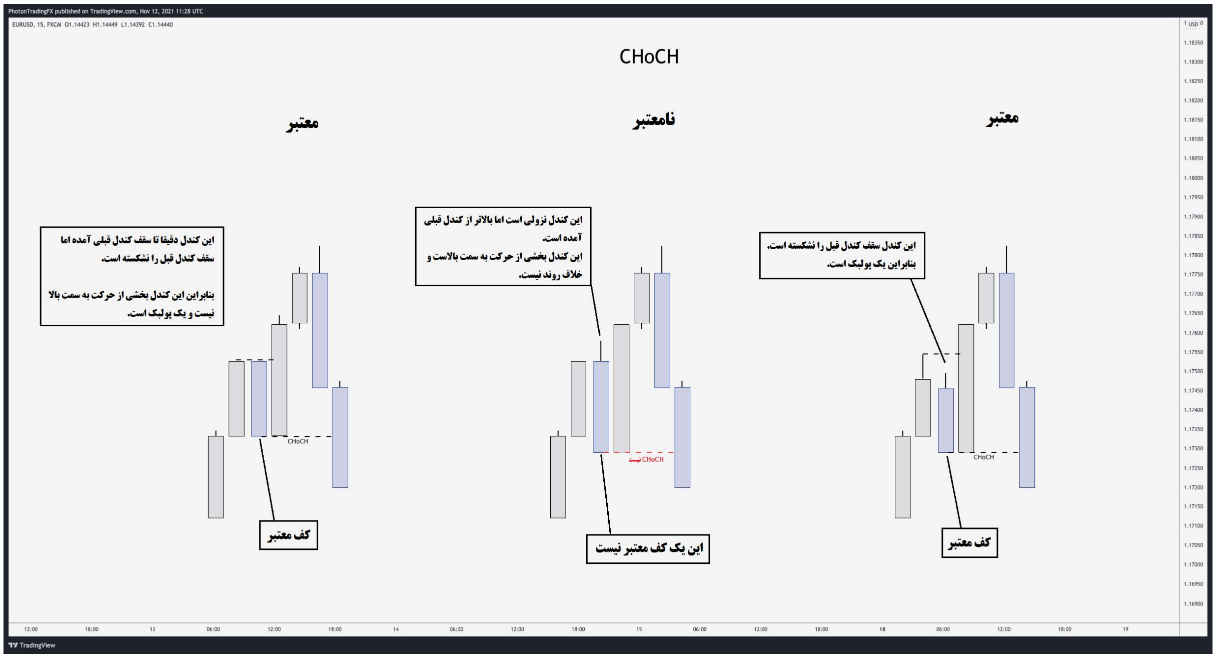
- یک کف داخلی زمانی تایید می‌شود که کندل بعدی نتواند کف را بشکند (پولبک داخلی).
- یک سقف پایین‌تر داخلی زمانی تایید می‌شود که قیمت سقف داخلی را بشکند (همیشه **نزدیک‌ترین** سقف داخلی را مشخص کنید).

تغییر ماهیت (CHoCH) ← تغییر ساختار داخلی از صعودی به نزولی و بالعکس.

تغییر ماهیت نزولی ← اولین کف پایین‌تر داخلی بعد از یک سری کف‌های بالاتر داخلی.

تغییر ماهیت صعودی ← اولین سقف بالاتر داخلی بعد از یک سری سقف‌های پایین‌تر داخلی.

از آن‌جایی که CHoCH تهاجمی‌ترین نوع شکست ساختار است، در لایوِ بازار تنها بر روی نواحی با ارزش بالا به دنبال CHoCH هستیم و در این نواحی مهم انتظار دیدن نقاط چرخش داریم. در مباحث آتی درباره تاییدیه‌های تکمیلی برای شناسایی نواحی با احتمال برد بالا خواهیم آموخت.



اینسایدبار:

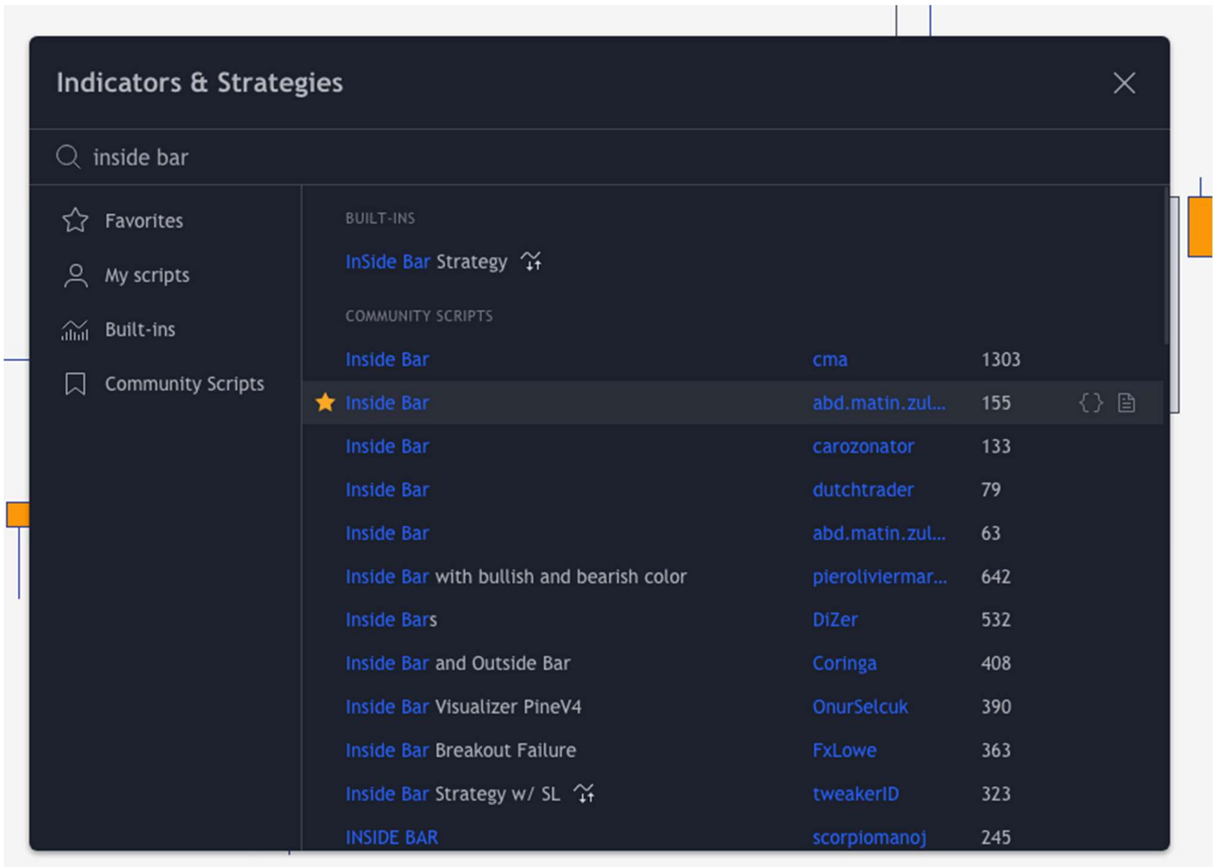
اینسایدبار کندلی است که نتوانسته سقف و کف کندل قبلی را بشکند. این کندل‌ها بیان‌گر یک رِنج در یک تایم‌فریم پایین‌تر هستند. این بدان معناست که یک اینسایدبار، یک پولبک داخلی است و می‌توانیم آن‌ها را به عنوان سقف‌ها و کف‌های داخلی به منظور شناسایی CHoCHها استفاده کنیم.



من از این اندیکاتور برای تغییر رنگ کندل‌های اینسایدبار به رنگ سفید استفاده می‌کنم:

/https://www.tradingview.com/script/EmPDpJ4e-Inside-Bar-v2

بر روی پنل اندیکاتورها در نوار بالایی تریدینگ‌ویو کلیک کنید و عبارت "inside bar" را سرچ کنید. من از دومین اندیکاتور در لیست "community scripts" استفاده می‌کنم اما به احتمال زیاد همه آن‌ها مثل هم هستند.



مشخص کردن ساختار سوییینگ (و داخلی)

سوییینگ سقف ← بالاترین نقطه‌ای که منشا تشکیل یک سوییینگ کف بوده است.

سوییینگ کف ← پایین‌ترین نقطه‌ای که منشا تشکیل یک سوییینگ سقف بوده است.

شکست ساختار ← شکست یک ساختار (سوییینگ) که باید با بسته شدن کندل (روش اول) باشد.

بعد از یک شکست ساختار، در همان تایم‌فریم انتظار پولبک داشته باشید.

ساختار داخلی ← هر ساختاری بین سوییینگ کف و سقف، ساختار داخلی محسوب می‌شود.

تغییر ماهیت (CHoCH) ← تغییر ساختار داخلی از صعودی به نزولی و بالعکس (توسط سایه کندل – روش دوم).

حداقل اندازه پولبکِ سوییینگ برای EURUSD که **برای خودم** انتخاب کردم به‌صورت زیر است:

- تایم‌فریم روزانه > ۹۰ پیپ
- تایم‌فریم ۴ ساعته > ۴۰ پیپ
- تایم‌فریم ۱۵ دقیقه > ۱۵ پیپ

شما می‌توانید از این اعداد به صورت قوانین سفت و سخت و ۱۰۰ درصد مکانیکی یا صرفا به‌عنوان راهنمایی عمومی استفاده کنید.

(توجه داشته باشید که میانگین نوسانات یک جفت‌ارز در طول زمان تغییر می‌کند، بنابراین شاید نیاز باشد که در آینده خودتان این اعداد را تنظیم کنید.)

برای تعیین قوانین و اعداد خودتان بر روی جفت ارز EURUSD یا هر جفت‌ارز و تایم‌فریم دیگری می‌توانید به صورت زیر عمل کنید:

۱. ساختار سوییینگ را بر اساس قضاوت خودتان و آنچه که از نظرتان یک سوییینگ پولبک با اهمیت می‌باشد مشخص کنید.

۲. اندازه همه آن پولبک‌ها را بر حسب پیپ بدست آورید.

۳. از اندازه پولبک‌ها میانگین بگیرید و به‌عنوان قوانین مکانیکی جدید خودتان یا راهنما استفاده کنید.

در مثال زیر توجه کنید که در نقطه ۳ کندل نتوانسته بالای سوییینگ سقف بسته شود (جمع‌آوری نقدینگی – درباره این مبحث در ادامه خواهیم آموخت). سپس قیمت برای تشکیل یک کف پایین‌تر سوییینگ کف را شکسته و پایین آن بسته شده و روند نزولی را ادامه داده است.

حالا سقف پایین‌تر جدید از سقف پایین‌تر قبلی بالاتر است، با این حال همچنان روند نزولی است!



مثال:



نواحی گران/ارزان

به نحوه مدیریت سهام یک بیزنس توجه کنید، آن‌ها زمانی که قیمت پایین است می‌خرند و زمانی که قیمت بالاست اقدام به فروش می‌کنند. در ترید جفت‌ارزها هم این شرایط برقرار است.

تریدهای خرید (لانگ) در نواحی ارزان شانس برد بالاتری دارند.

تریدهای فروش (شورت) در نواحی گران شانس برد بالاتری دارند.

برای مشخص کردن نواحی گران/ارزان به صورت زیر عمل کنید:

۱. لگ یا رنج قیمت در هر تایم‌فریمی که هستید را مشخص کنید.

۲. از ابزار فیبوناچی و سطح ۵۰ درصد آن برای مشخص کردن سطح تعادل[1] استفاده کنید.

۳. اگر لگ/رنج قیمت صعودی است قبل از خرید صبر کنید تا قیمت به ناحیه ارزان برسد.

۴. اگر لگ/رنج قیمت نزولی است قبل از فروش صبر کنید تا قیمت به ناحیه گران برسد.

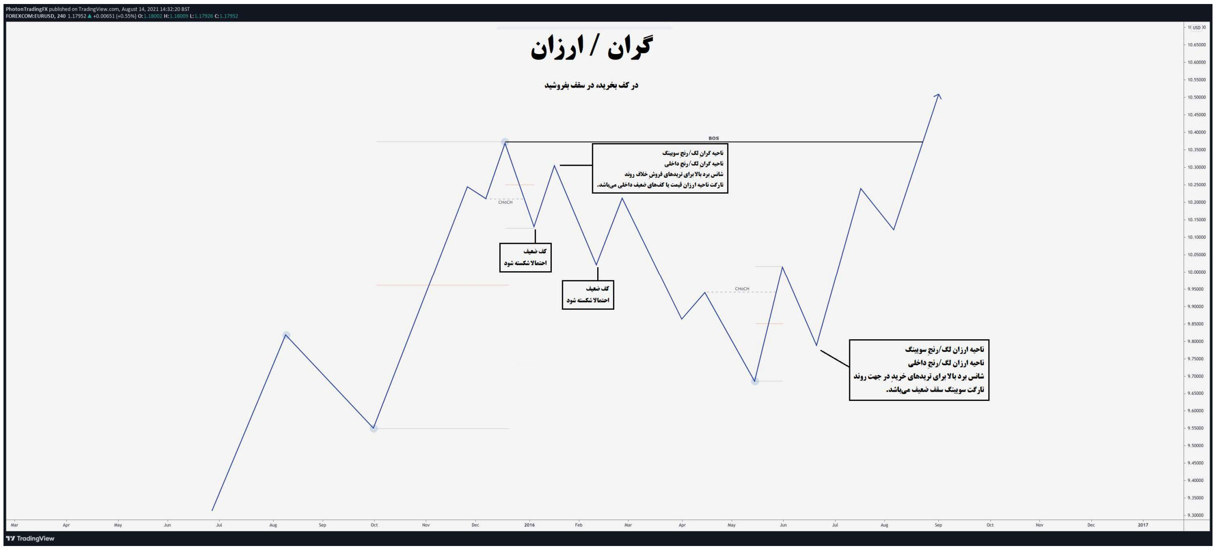


---

[1] Equilibrium (EQ)

در بازار صعودی لازم نیست که قیمت برای تشکیل کف بالاتر به ناحیه ارزان پولبک بزند.

در بازار نزولی لازم نیست که قیمت برای تشکیل سقف پایین‌تر به ناحیه گران پولبک بزند.



ساختار بازار مولتی تایم‌فریم

تحلیل مولتی تایم‌فریم[۱] ← تحلیل چندین تایم‌فریم در کنار یکدیگر.

رفتار قیمت فرکتالی (خودمتشابه) است، یعنی:

حرکات قیمت در تایم‌فریم پایین‌تر، حرکات قیمت در تایم‌فریم بالاتر را می‌سازد. هر اتفاقی که در تایم‌فریم بالاتر می‌افتد باید ابتدا در تایم‌فریم پایین‌تر اتفاق بیفتد.

فعالیت‌های مستمر و با ثبات = نتایج مستمر و با ثبات

استفاده از یک سِت تایم‌فریم برای بررسی ساختار بازار برای رسیدن به نتایج مستمر ضروری است.

- ✓ تایم‌فریم بالاتر ← داستان قیمت: آیا در حال ترید در جهت روند هستیم یا یک پولبک؟
- ✓ تایم‌فریم میانی ← سوءگیری سریع: تاییدیه برای زمانی که روند تایم‌فریم بالاتر در حال اتمام و پولبک در حال شروع شدن است (و بالعکس).
- ✓ تایم‌فریم پایین‌تر ← ورود: تاییدیه برای نقاط چرخش در تایم‌فریم میانی

برای مثال:

تایم‌فریم بالاتر ← ۴ ساعته / تایم‌فریم میانی ← ۱۵ دقیقه / تایم‌فریم پایین‌تر ← ۱ دقیقه

تایم‌فریم بالاتر ← روزانه / تایم‌فریم میانی ← ۴ ساعته / تایم‌فریم پایین‌تر ← ۱۵ دقیقه

با دانستن داستان قیمت در تایم‌فریم بالاتر و بررسی فعالانه حرکات قیمت در تایم‌فریم میانی، ستاپ‌های معاملاتی خودشان را نشان می‌دهند.

وظیفه ما این است که در اطراف نواحی مستعد و بالقوه برای ترید[۲] حرکات قیمت را بررسی کنیم و با ذهنی خنثی و بدون سوگیری به چیزی که بازار به ما می‌گوید گوش دهیم.

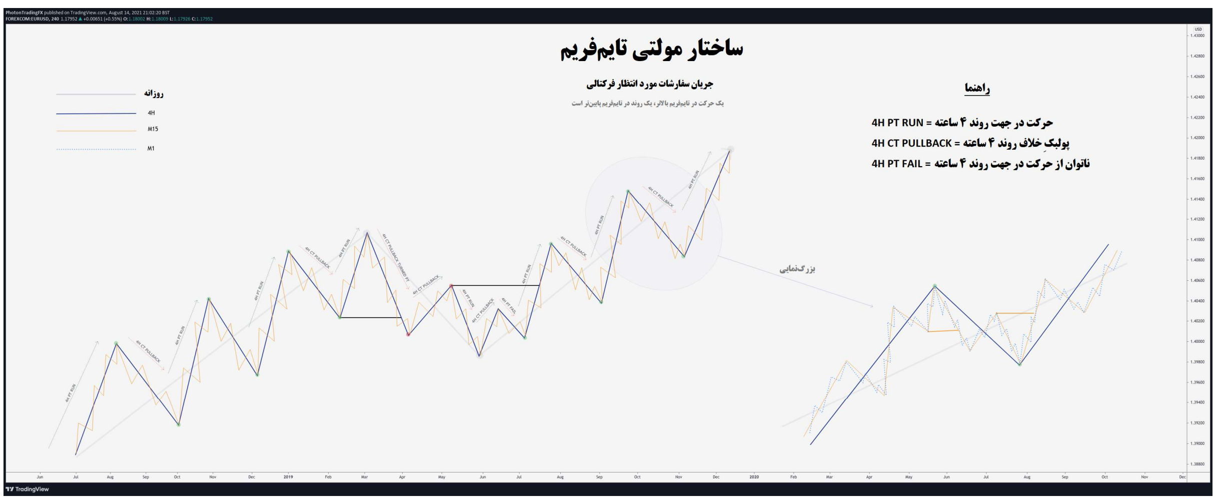
رفتار ساختاری تایم‌فریم پایین‌تر در نواحی مستعد برای ترید به ما کمک می‌کند تا در جهت جریان بازار بمانیم و تریدهایمان را در یک هارمونی با بازار اجرا کنیم.

این یک چارچوب مکانیکی (قانون‌مند) است که به ما کمک می‌کند در جریان سفارشات بازار باشیم.

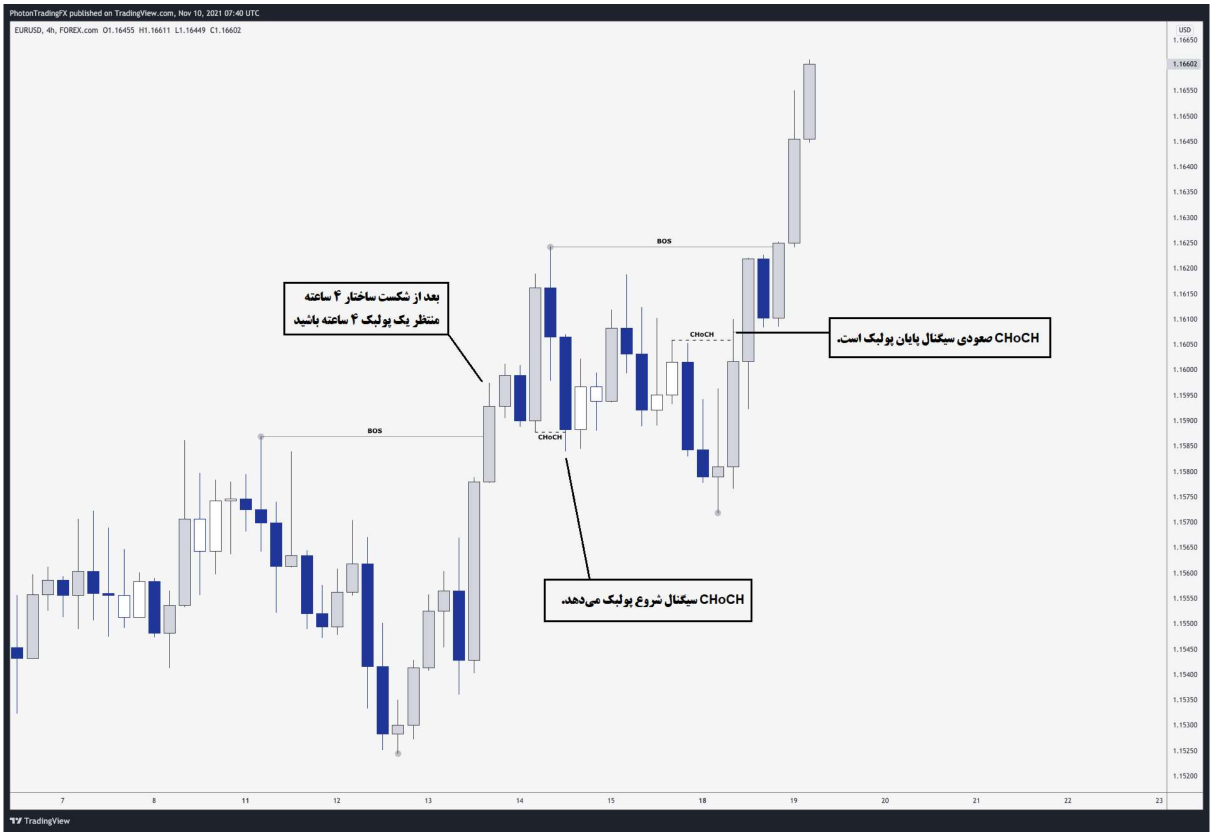
---

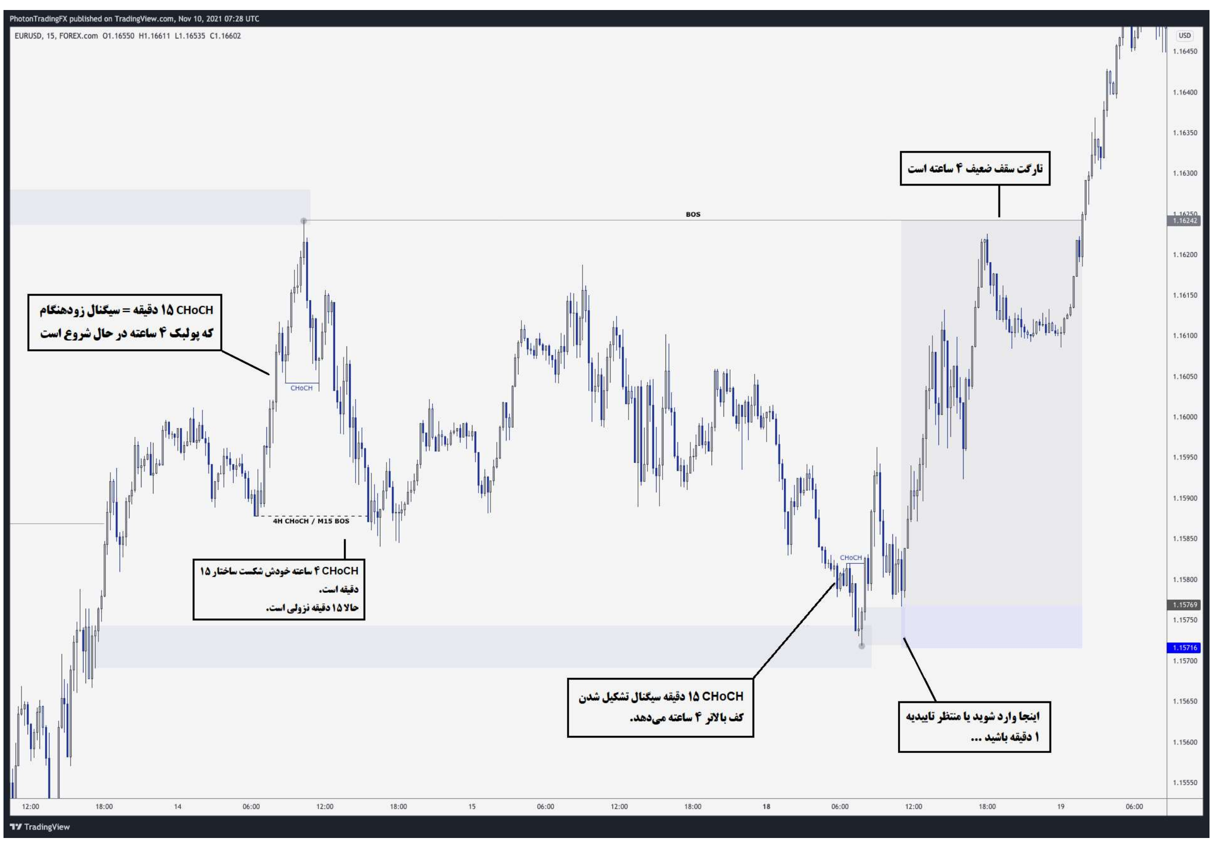
[۱] Multi-timeframe (MTF)
[۲] Point of interest (POI)


ساختار مولتی تایم‌فریم
جریان سفارشات مورد انتظار فرکتالی
یک حرکت در تایم‌فریم بالاتر، یک روند در تایم‌فریم پایین‌تر است
ساختار تایم‌فریم بالاتر
ساختار تایم‌فریم پایین‌تر
TradingView


ساختار مولتی تایم‌فریم
جریان سفارشات مورد انتظار فرکتالی
یک حرکت در تایم‌فریم بالاتر، یک روند در تایم‌فریم پایین‌تر است
روزانه
4H
M15
M1
راهنما
4H PT RUN = حرکت در جهت روند ۴ ساعته
4H CT PULLBACK = پولبک خلاف روند ۴ ساعته
4H PT FAIL = ناتوان از حرکت در جهت روند ۴ ساعته
بزرگ‌نمایی
TradingView


ساختار مولتی تایم‌فریم
جریان سفارشات مورد انتظار فرکتالی
یک حرکت در تایم‌فریم بالاتر، یک روند در تایم‌فریم پایین‌تر است
4H
M15
M1
همیشه از تایم‌فریم‌های بالاتر برای تعیین جهت کلی شروع کنید.
کارتان را تا تایم‌فریم پایین‌تر به منظور بهینه‌سازی نواحی و زمان ورود ادامه دهید.
BOS
۱. ساختار ۴ ساعته صعودی است
۲. بعد از BOS انتظار پولبک در تایم‌فریم ۴ ساعته تا ناحیه ارزان لگ ۴ ساعته داریم.
۳. شروع جریان سفارشات نزولی داخلی
۴. حالا قیمت تا ناحیه ارزان پولبک زده است و شانس تشکیل کف بالاترِ ۴ ساعته افزایش یافته است.
برای تاییدیه منتظر CHoCH صعودی در ۱۵ دقیقه باشید.
۵. CHoCH در ۱۵ دقیقه
حالا با روند صعودی ۴ ساعته هم‌راستا می‌شود.
۶. قیمت به ناحیه ارزان ۱۵ دقیقه پولبک می‌زند و شانس تشکیل کف بالاترِ ۱۵ دقیقه افزایش یافته است.
برای تاییدیه منتظر CHoCH صعودی در ۱ دقیقه باشید.
۷. CHoCH در ۱ دقیقه کف بالاترِ ۱۵ دقیقه را تایید می‌کند.
حالا همه تایم‌فریم‌ها در جهت شروع سویینگ ۴ ساعته هم‌راستا هستند.
تارگت سویینگ سقفِ ضعیف ۴ ساعته می‌باشد.
TradingView


PhotonTradingFX published on TradingView.com, Nov 10, 2021 07:40 UTC
EURUSD, 4h, FOREX.com O1.16455 H1.16611 L1.16449 C1.16602
بعد از شکست ساختار ۴ ساعته
منتظر یک پولبک ۴ ساعته باشید
BOS
CHoCH
CHoCH صعودی سیگنال پایان پولبک است.
CHoCH سیگنال شروع پولبک می‌دهد.
TradingView


PhotonTradingFX published on TradingView.com, Nov 10, 2021 07:28 UTC
EURUSD, 15, FOREX.com O1.16550 H1.16611 L1.16535 C1.16602
تارگت سقف ضعیف ۴ ساعته است
BOS
CHoCH ۱۵ دقیقه = سیگنال زودهنگام
که پولبک ۴ ساعته در حال شروع است
CHoCH
4H CHoCH / M15 BOS
CHoCH ۴ ساعته خودش شکست ساختار ۱۵
دقیقه است.
حالا ۱۵ دقیقه نزولی است.
CHoCH ۱۵ دقیقه سیگنال تشکیل شدن
کف بالاتر ۴ ساعته می‌دهد.
اینجا وارد شوید یا منتظر تاییدیه
۱ دقیقه باشید ...
TradingView


PhotonTradingFX published on TradingView.com, Nov 10, 2021 07:34 UTC
EURUSD, 1, FOREX.com O1.16598 H1.16611 L1.16593 C1.16602
CHoCH
M1
M15
سیگنال CHoCH ۱ دقیقه:
– ناحیه تقاضای ۱۵ دقیقه قیمت را نگه داشته
– کف بالاتر ۱۵ دقیقه تشکیل شده
– کف بالاتر ۴ ساعته تشکیل شده
همه تایم‌فریم‌ها هم‌راستا هستند
= نرخ برد بالا
= نسبت ریوارد به ریسک بالا
TradingView

فصل دوم:

عرضه و تقاضا

ساز و کار بازار

همان‌طور که تاریخ بارها نشان داده است، سفته‌بازان (تریدرهایی که از نوسانات سود می‌گیرند) معمولا گروه‌های هستند که احساسات بر آن‌ها اثر می‌گذارد. زمانی که میلیون‌ها تریدر در بازی پول گرد هم می‌آیند که با ترس، طمع و عدم قطعیت همراه است، رفتار آن‌ها نوعی "ذهنیت گله‌ای" به خود می‌گیرد.

نرخ تبادل ارزها در توسط تقاضا و عرضه از سوی سفته‌بازانِ بازار بالا و پایین می‌شود. هر روزه سرمایه‌گذاران و تریدرها، چه سازمانی و چه شخصی، ارزها را خرید و فروش می‌کنند. هر شرکت‌کننده‌ای در بازار بر اساس دلیل خاص خودش اقدام به خرید یا فروش می‌کند. هر کدام دیدگاه، ایده و باور خاص خودشان را درباره ارزش ترید جفت‌ارزها دارند. نقطه ملاقات خریداران و فروشندگان، به هر دلیلی که اقدام می‌کنند، قیمت است.

تا زمانی که هر دو طرف خریدار و فروشنده بر روی یک قیمت به توافق نرسند معامله‌ای صورت نمی‌گیرد.

بنابراین دلیل حرکت جفت‌ارزها موارد زیر است:

خریداران در یک جفت‌ارز ایجاد تقاضا می‌کنند و فشار صعودی بر روی قیمت ایجاد می‌کنند.

فروشندگان ایجاد عرضه می‌کنند و فشار نزولی بر روی قیمت ایجاد می‌کنند.

بازار به صورت مستمر در طول روز مانند یک حراجی کار می‌کند که خریداران و فروشندگان برای دستیابی به بهترین قیمت با یکدیگر رقابت می‌کنند.

تحلیل تکنیکال ← چارچوب و ابزاری است برای شناسایی موقعیت‌های معاملاتی با استفاده از مطالعه حرکات قیمت و حجم که حاصل جنگ بین خریداران و فروشندگان است.

عرضه و تقاضا محرک **جریان سفارشات** است، نتیجه جریان سفارشات **حرکات قیمت** است و حرکات قیمت **الگوها** را می‌سازند.

برهم‌کنش میلیون‌ها شرکت کننده که هرکدام دلایل، احساسات و دستوالعمل مخصوص به خود را دارند، الگوهای قیمت را می‌سازند که در بازه‌های زمانی طولانی رخ می‌دهند و می‌توانند برای پیش‌بینی حرکات آتی قیمت و پیدا کردن موقعیت‌های با احتمال برد بالا استفاده شوند.

عرضه و تقاضا

با ریزش قیمت تقاضا افزایش می‌یابد.

با افزایش قیمت عرضه افزایش می‌یابد.

جایی که مقدار تقاضا با مقدار عرضه در بازار برابر شود، آن‌جا قیمت لحظه‌ای بازار است. قیمت هر لحظه میکرو پیپ به میکرو پیپ حرکت می‌کند تا بین عرضه و تقاضا (فروشندگان و خریداران) تعادل ایجاد شود. اگر یک عدم تعادل بزرگ بین عرضه و تقاضا ایجاد شود، قیمت به سرعت حرکت می‌کند تا به قیمت منصفانه جدید برسد. موسسات مالی بزرگ نمی‌توانند عدم تعادل‌های بزرگ عرضه و تقاضایی که خودشان ایجاد کرده‌اند را مخفی کنند. زمانی که سفارشات بزرگ خود را قرار می‌دهند قیمت به سرعت حرکت می‌کند و قیمت می‌تواند دوباره به تعادل برسد. هر تایم‌فریمی بارها و بارها این الگوها را نشان خواهد داد و می‌توانید رد پای فعالیت موسسات را ببینید. استفاده از همه تایم‌فریم‌ها در کنار یکدیگر تصویر واضح‌تری از محل ورود و خروج بازیگران بزرگ ارائه می‌دهد، بنابراین ما هم می‌توانیم با دقت بالایی ورود و خروج‌های خود را تنظیم کنیم و با جریان سفارشات بزرگ آن‌ها همراه شویم.

جریان سفارشات

جریان سفارشات ← بازیِ داخلی بین سفارشات منفعل و تهاجمی می‌باشد (برهم‌کنش بین خریداران و فروشندگان).

سفارشات منفعل ← سفارشات لیمیت و استاپ که در اردربوک قابل مشاهده است (صبر کردن برای برخورد قیمت به آن‌ها).

- لیمیت: خرید/فروش در یک قیمت مشخص (*یا بهتر*) پایین/بالای قیمت فعلی بازار
- استاپ: خرید/فروش در یک قیمت مشخص (*یا بدتر*) بالا/پایین قیمت فعلی بازار

سفارشات تهاجمی ← سفارشات مارکت (ورود فوری در قیمت لحظه بازار)

- سفارش مارکت: خرید/فروش فوری در قیمت bid/ask لحظه‌ای بازار

اردربوک ← لیست سفارشات خرید و فروش در هر سطح قیمتی

حرکات قیمت در چارت کندلی جریان سفارشاتی که در اردربوک می‌توانید ببینید را تصویر می‌کند. چارت کندلی این امکان را به شما می‌دهد که مناطق عدم تعادل بین عرضه و تقاضا را شناسایی کنید:

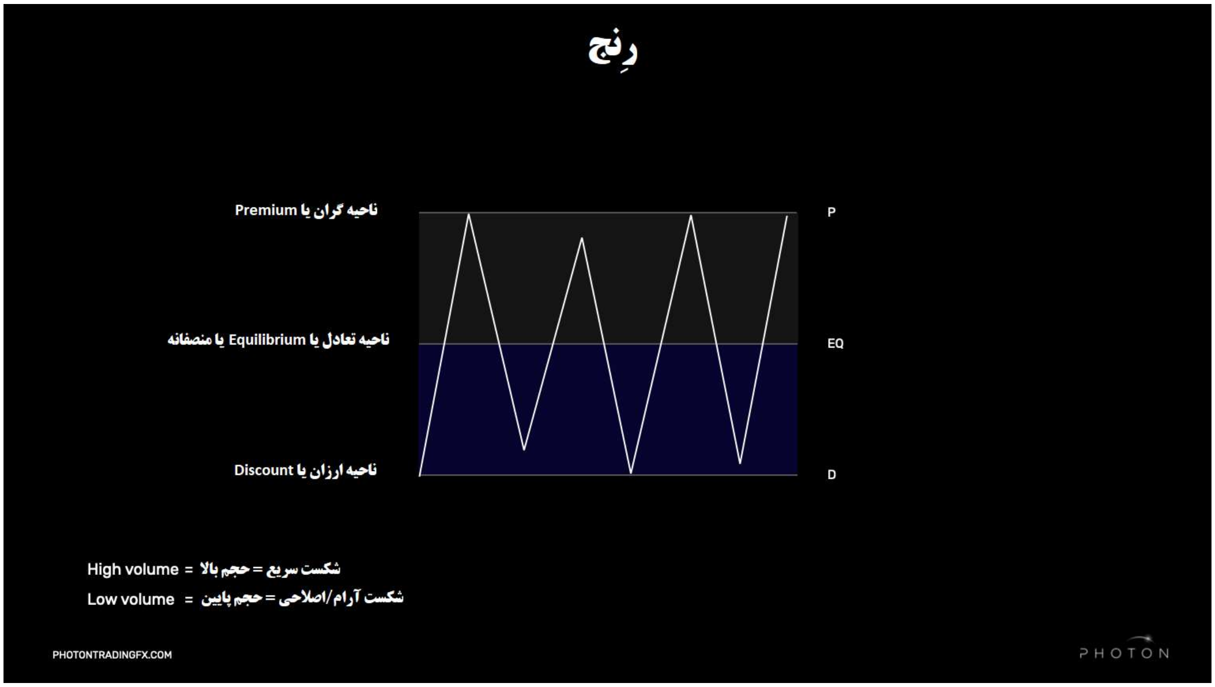
- در جایی خرید کنید که حجم زیادی تقاضا وارد بازار شده است
- در جایی بفروشید که حجم زیادی عرضه وارد بازار شده است

از مفهوم ساختار بازار استفاده کنید تا مناطق دقیق و با ارزش بالا که در آن‌ها ترید می‌کنیم را شناسایی کنید، سپس عرضه و تقاضا یک ابزار قدرتمند دیگری است که ما را در بهینه‌سازی و زمان‌بندی مناسب کمک می‌کند.

ایجاد نواحی عرضه و تقاضا

اکثر فعالیت‌های موسسات بزرگ تنها سفارشات تجاری و تراکنش‌هایی است که به‌وسیله بازار و عموما با الگوریتم‌های پیچیده انجام می‌شود. اما می‌توانیم با استفاده از چارت کندلی و تایم‌فریم‌های مختلف آن بازی‌های داخلی پیچیده را معنا کنیم.

✓ **رِنج ← درجا زدن قیمت (حرکت‌های سایدِ اصلاحی/کانسولیدیشن)**



رنج‌ها موارد زیر را نشان می‌دهند:

۱. حجم بالا ← سفارشات زیادی در حال دست به دست شدن است و احتمالا بازیگران بزرگ در حال پر کردن سفارشات خودشان در قیمت‌های منصفانه هستند (نواحی تجمیع/توزیع[۱]).

۲. حجم کم ← فعالیت‌های کوچک در بازار

ما منتظر می‌مانیم تا ببینیم **پس از** تشکیل رنج چه اتفاقی می‌افتد:

حجم بالا = شکست سریع و پایدار رنج و دور شدن قیمت

حجم پایین = قیمت به آرامی حرکت می‌کند

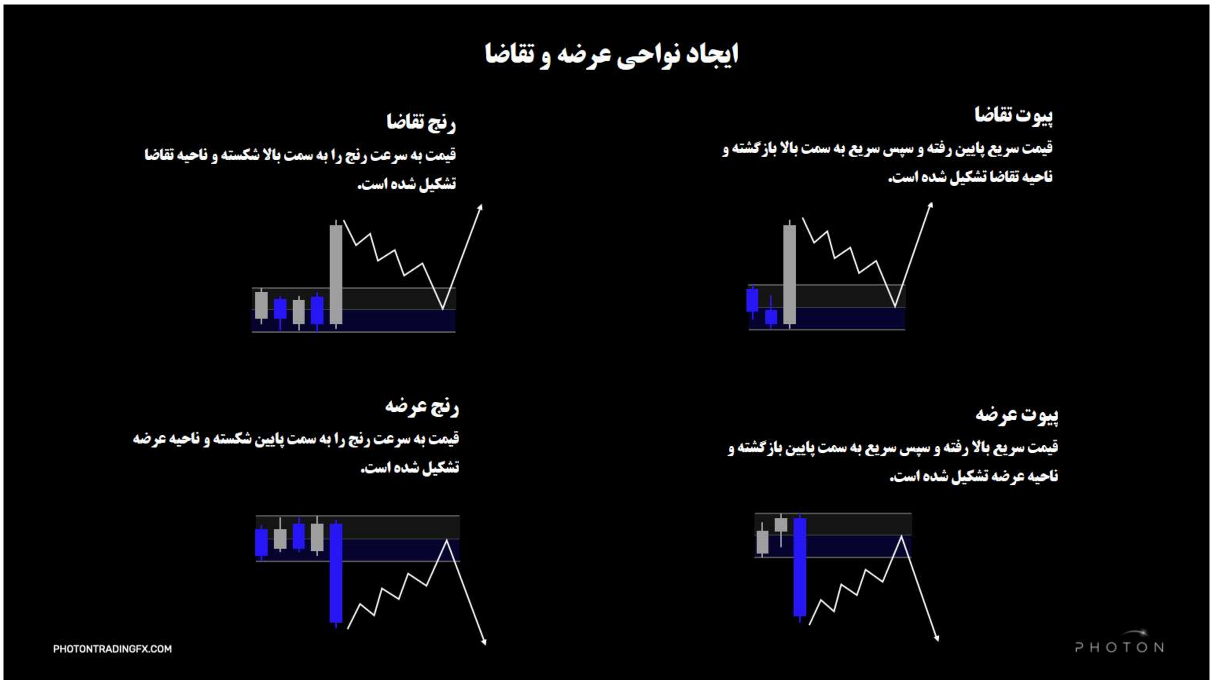
ما به دنبال شکست‌های رنج با حجم بالا هستیم، چون نشان‌دهنده یک عدم تعادل واضح بین عرضه و تقاضا و سیگنال علاقه موسسات به آن سطح قیمت هستند.

---

[۱] Accumulation/Distribution

نواحی عرضه و تقاضا حاصل عدم تعادل‌های بین عرضه و تقاضا است. ما می‌توانیم پس از شکسته شدن یک رنج این نواحی را شناسایی و بر روی چارت مشخص کنیم. این نواحی می‌توانند به صورت رنج یا پیوُت[۱] باشند.

ما شکست اولیه رنج‌ها را ترید نمی‌کنیم و به جای آن صبر می‌کنیم تا قیمت دست خودش را رو کند و ببینیم به چه جهتی می‌خواهد حرکت کند. صبر کنید تا قیمت به ناحیه برگردد و سپس به دنبال مدل‌های ورود بالقوه باشید. از ناحیه تقاضا بخرید و از ناحیه عرضه بفروشید.



مسئله‌ای که مشخص می‌کند ناحیه عرضه یا تقاضا ادامه‌دهنده است یا بازگشتی، جهت حرکت قیمت قبل از ساخته شدن ناحیه است.

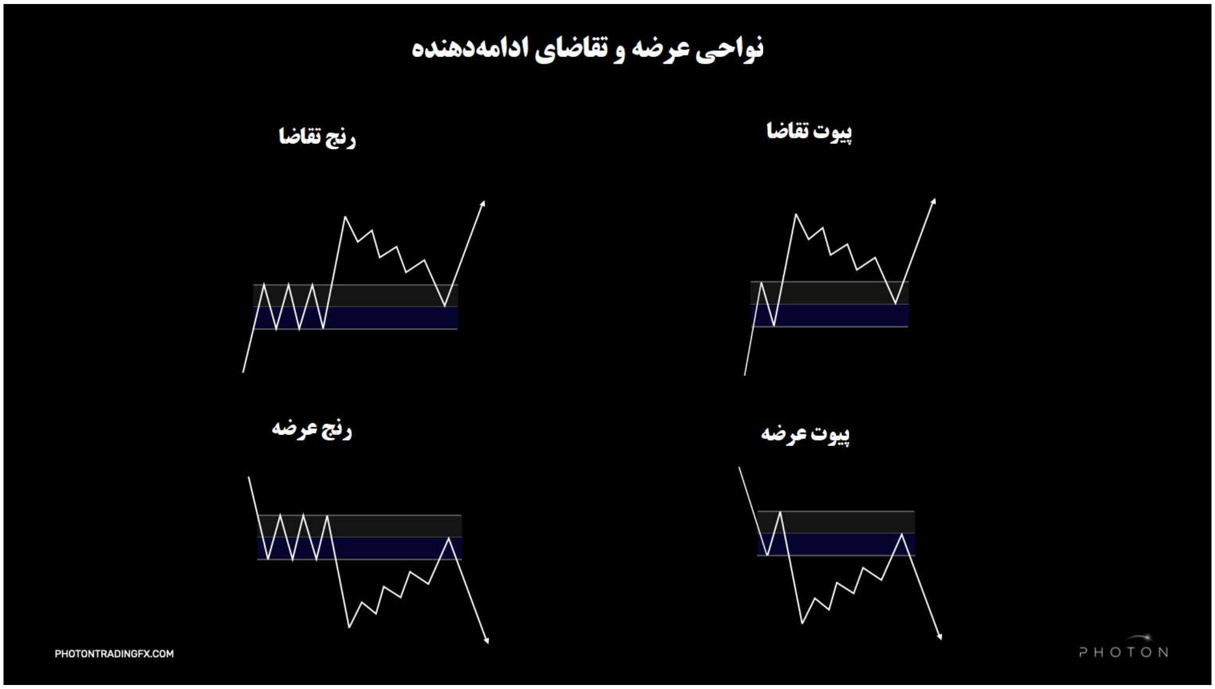
نواحی عرضه و تقاضای ادامه‌دهنده:

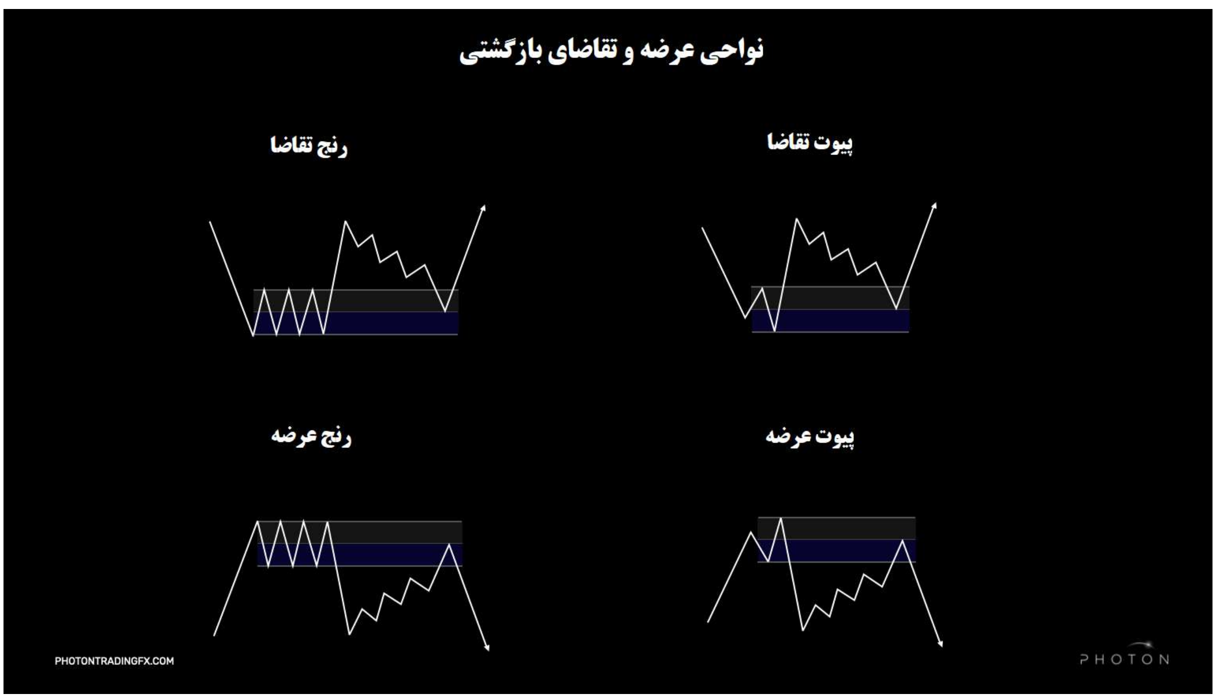
- تقاضای ادامه‌دهنده ← قیمت قبل از ناحیه صعودی است
- عرضه‌ی ادامه‌دهنده ← قیمت قبل از ناحیه نزولی است

نواحی عرضه و تقاضای بازگشتی:

- تقاضای بازگشتی ← قیمت قبل از ناحیه نزولی است
- عرضه‌ی بازگشتی ← قیمت قبل از ناحیه صعودی است

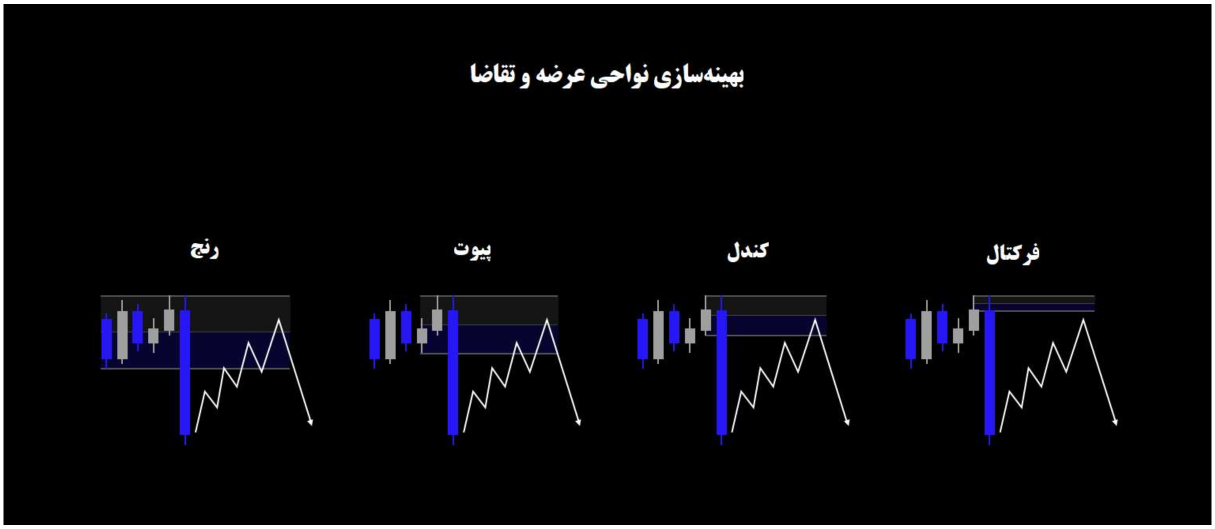
[۱] Pivot


نواحی عرضه و تقاضای ادامه‌دهنده
رنج تقاضا
پیوت تقاضا
رنج عرضه
پیوت عرضه
PHOTONTRADINGFX.COM
PHOTON


نواحی عرضه و تقاضای بازگشتی
رنج تقاضا
پیوت تقاضا
رنج عرضه
پیوت عرضه
PHOTONTRADINGFX.COM
PHOTON

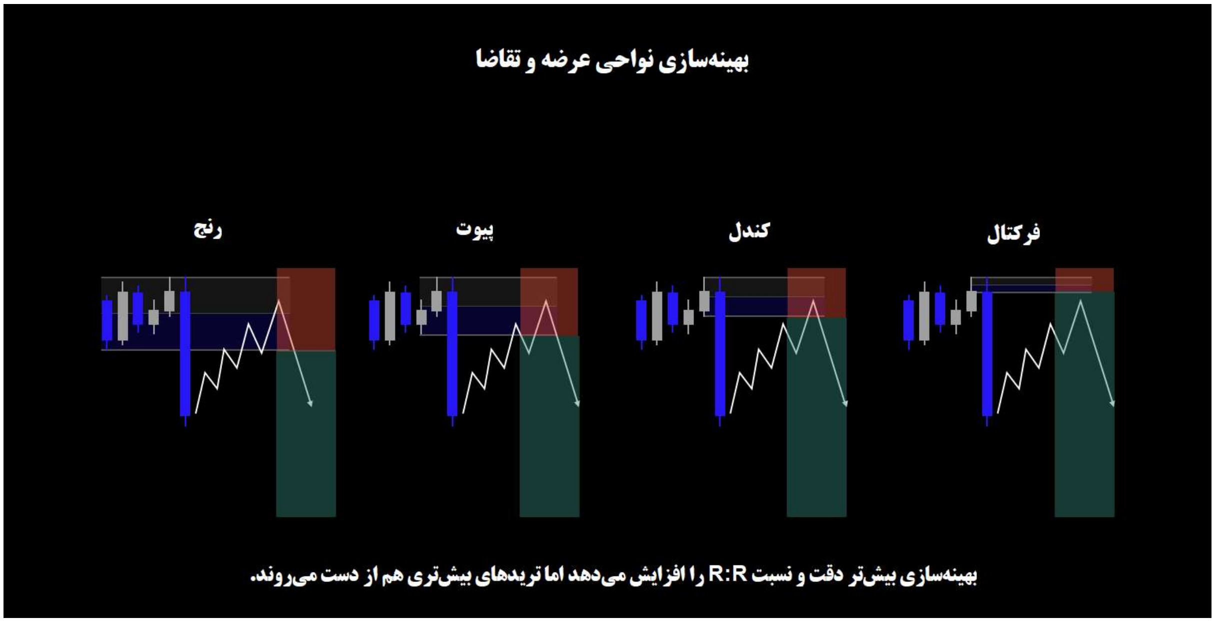
بهینه‌سازی نواحی عرضه و تقاضا

یک رنج که تشکیل ناحیه عرضه داده است می‌تواند تا اندازه پیوت بهینه شود یا حتی تا اندازه سایه کندل (فرکتال) کوچک شود.

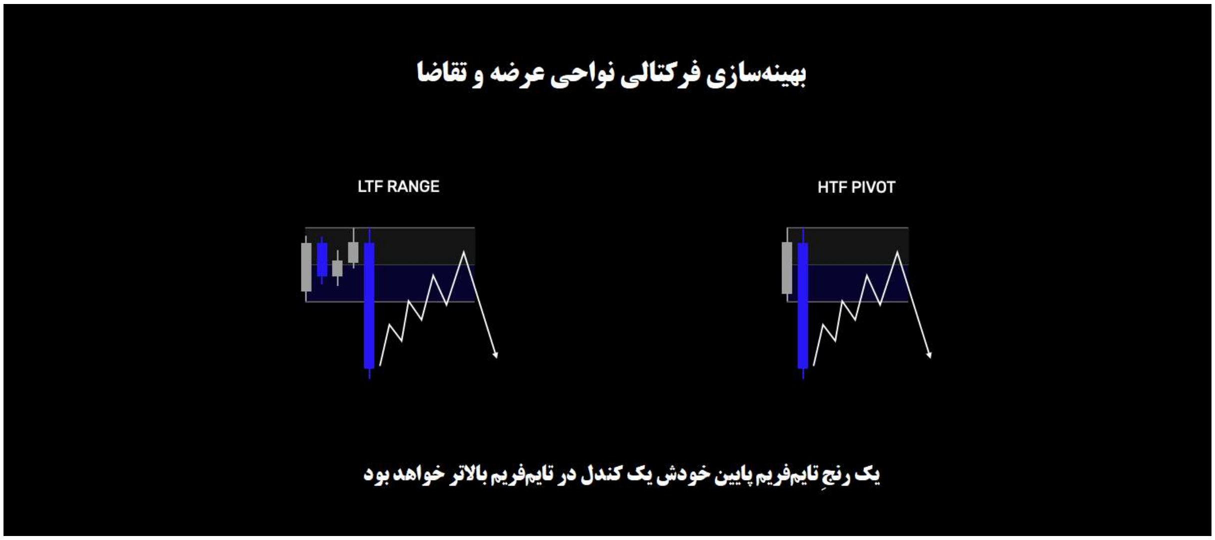


ما به دنبال ورود در ابتدا یا داخل ناحیه هستیم و همیشه استاپ‌لاس خود را پشت ناحیه قرار می‌دهیم.

بهینه‌سازی بیش‌تر سبب می‌شود تا دقت افزایش یابد و نسبت ریوارد به ریسک (R:R) بالاتری بگیریم اما احتمال اینکه قیمت به ناحیه نرسد و ترید از دست برود هم افزایش می‌یابد.



یک ناحیه رنج یا حتی یک ناحیه پیوت با چندین کندل، یک پیوت در تایم‌فریم بالاتر خواهند بود.



سه نوع بهینه‌سازی فرکتالی:

۱. اینسایدبارها ← اینسایدبارها نشان‌دهنده یک ناحیه رنج در تایم‌فریم پایین‌تر هستند.

اینسایدبار کندلی است که سقف و کف کندل قبل را نشکسته و سپس توسط کندل بعدی اینگولف شده است.

برای ما صعودی یا نزولی بودن کندل اینسایدبار اهمیتی ندارد، ما فقط نگاه می‌کنیم که بعد از تشکیل اینسایدبار قیمت به کدام سمت حرکت می‌کند.

تقاضا = شکست از بالا. عرضه = شکست از پایین.

۲. سایه‌های STB[۱] و BTS[۲] ← این نواحی نشان‌دهنده یک پولبک در تایم‌فریم پایین‌تر هستند.

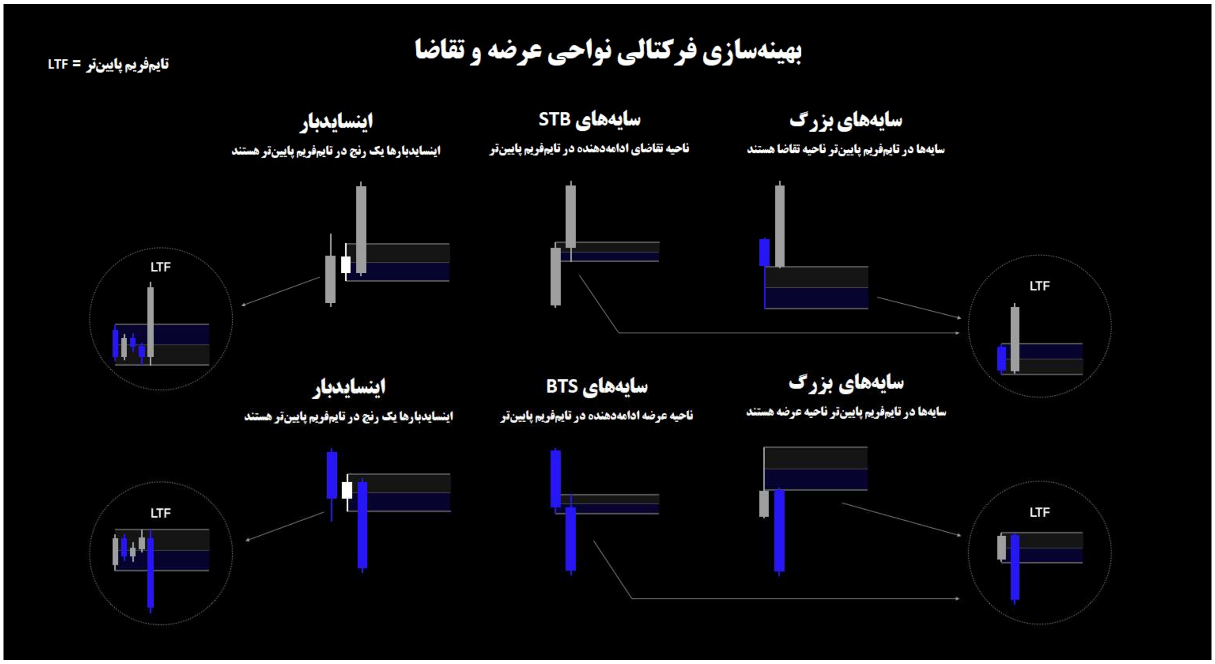
این سایه‌ها یک پیوت یا رنج در تایم‌فریم پایین‌تر خواهند بود که در تایم‌فریم بالاتر به‌صورت سایه دیده می‌شوند.

۳. سایه‌های بزرگ ← این سایه‌ها یک ناحیه رنج یا پیوت در تایم‌فریم پایین‌تر هستند.

---

[۱] رنج از فروش تا خرید (Sell to Buy)

[۲] رنج از خرید تا فروش (Buy to Sell)


بهینه‌سازی فرکتالی نواحی عرضه و تقاضا
تایم‌فریم پایین‌تر = LTF
سایه‌های بزرگ
سایه‌ها در تایم‌فریم پایین‌تر ناحیه تقاضا هستند
سایه‌های STB
ناحیه تقاضای ادامه‌دهنده در تایم‌فریم پایین‌تر
اینسایدبار
اینسایدبارها یک رنج در تایم‌فریم پایین‌تر هستند
LTF
LTF
سایه‌های بزرگ
سایه‌ها در تایم‌فریم پایین‌تر ناحیه عرضه هستند
سایه‌های BTS
ناحیه عرضه ادامه‌دهنده در تایم‌فریم پایین‌تر
اینسایدبار
اینسایدبارها یک رنج در تایم‌فریم پایین‌تر هستند
LTF
LTF

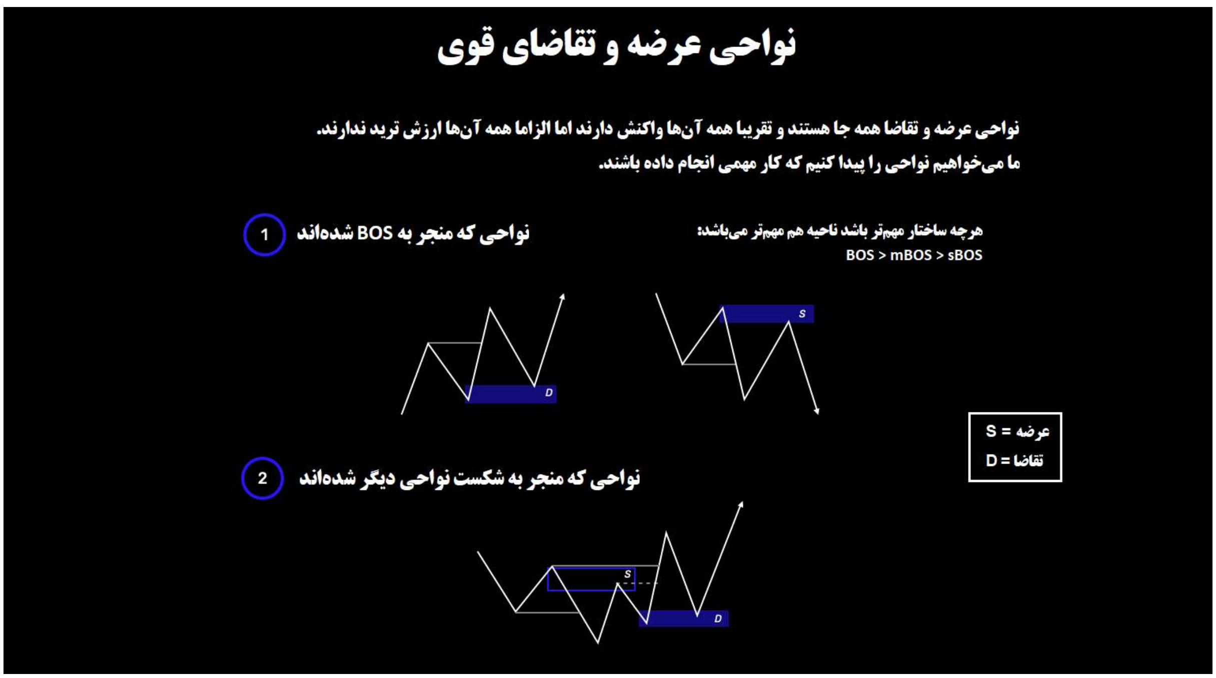
نواحی عرضه و تقاضای قوی

نواحی عرضه و تقاضا در همه جا مشاهده می‌شوند، تقریبا همه آن‌ها به نوعی یک واکنش خواهند داشت اما همه آن‌ها ارزش ترید و اینکه سرمایه خود را ریسک کنید ندارند. ما می‌خواهیم نواحی را پیدا کنیم که کار مهمی انجام داده باشند. ۲ مورد از روش‌های اصلی که برای اعتبارسنجی یک ناحیه عرضه یا تقاضا استفاده می‌کنیم عبارت‌اند از:

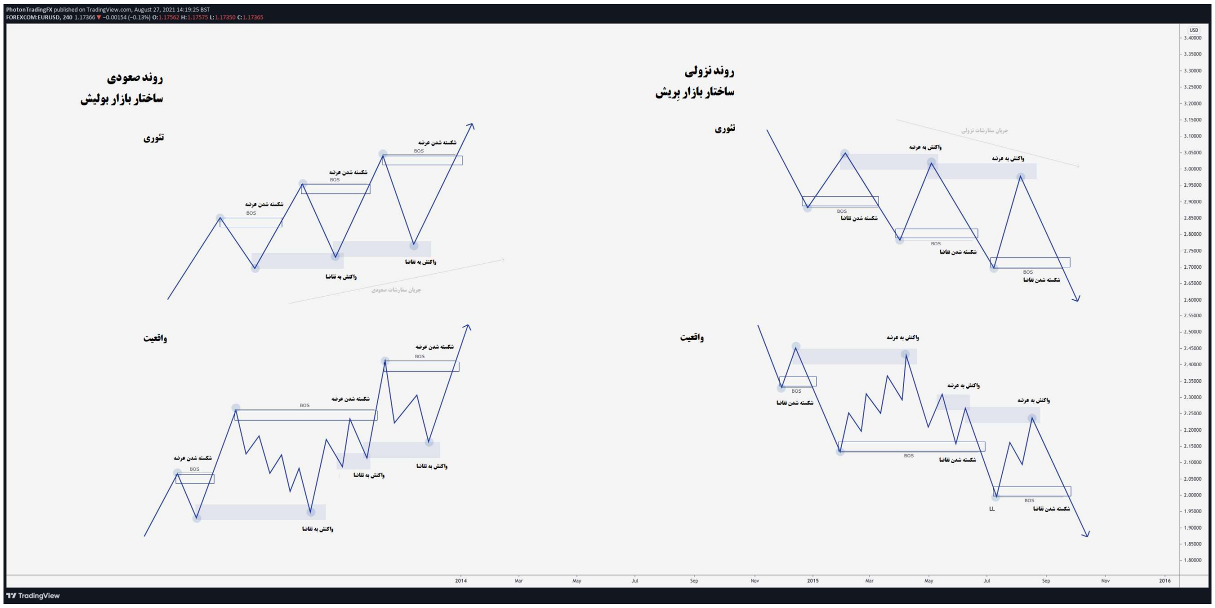
۱. **نواحی که باعث شکست ساختار (BOS) شده‌اند** ← هر چقدر ساختار مهم‌تر باشد، ناحیه مهم‌تر خواهد بود (ارزش ساختارها: BOS > mBOS > sBOS)

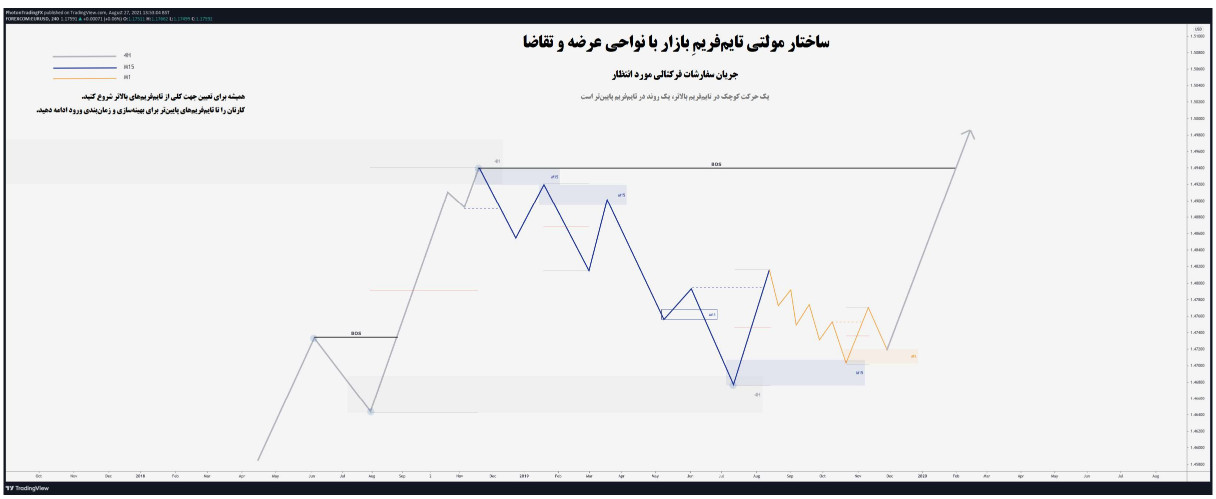
۲. **ناحیه که باعث شده باشد یک ناحیه دیگر شکسته شود (نواحی فلیپ / Flip)**

ترکیب هر دو روش نواحی با احتمال برد بسیار بالایی ایجاد می‌کنند، مخصوصا زمانی که با مفاهیم دیگری مانند ساختار مارکت، نقدینگی و غیره همراه باشند.



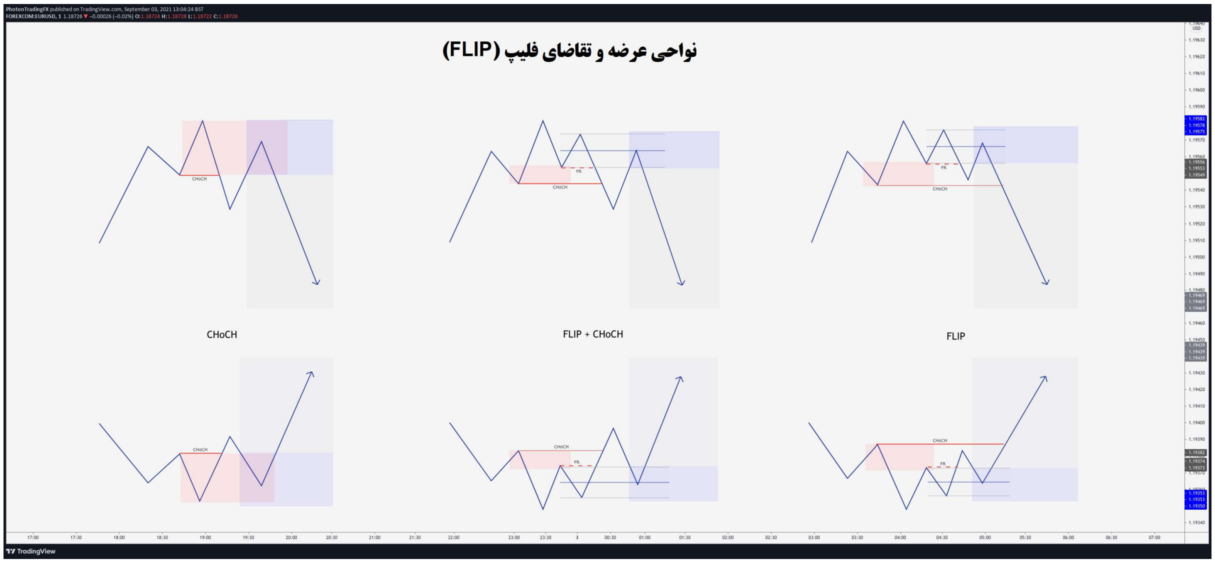
نواحی عرضه و تقاضای ساختار

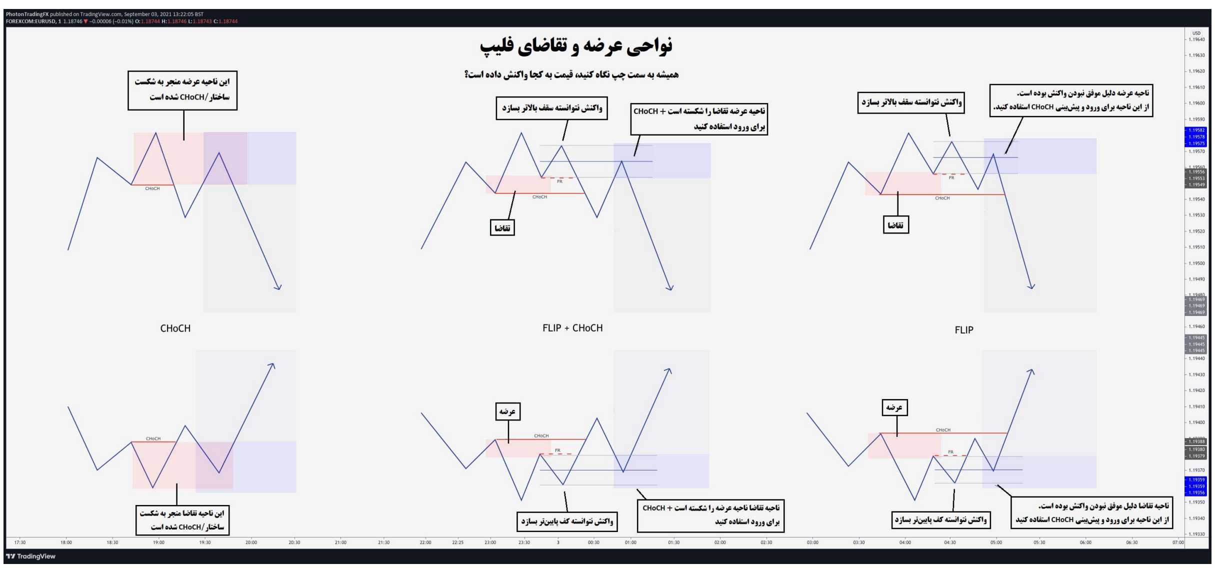






نواحی عرضه و تقاضای فلیپ

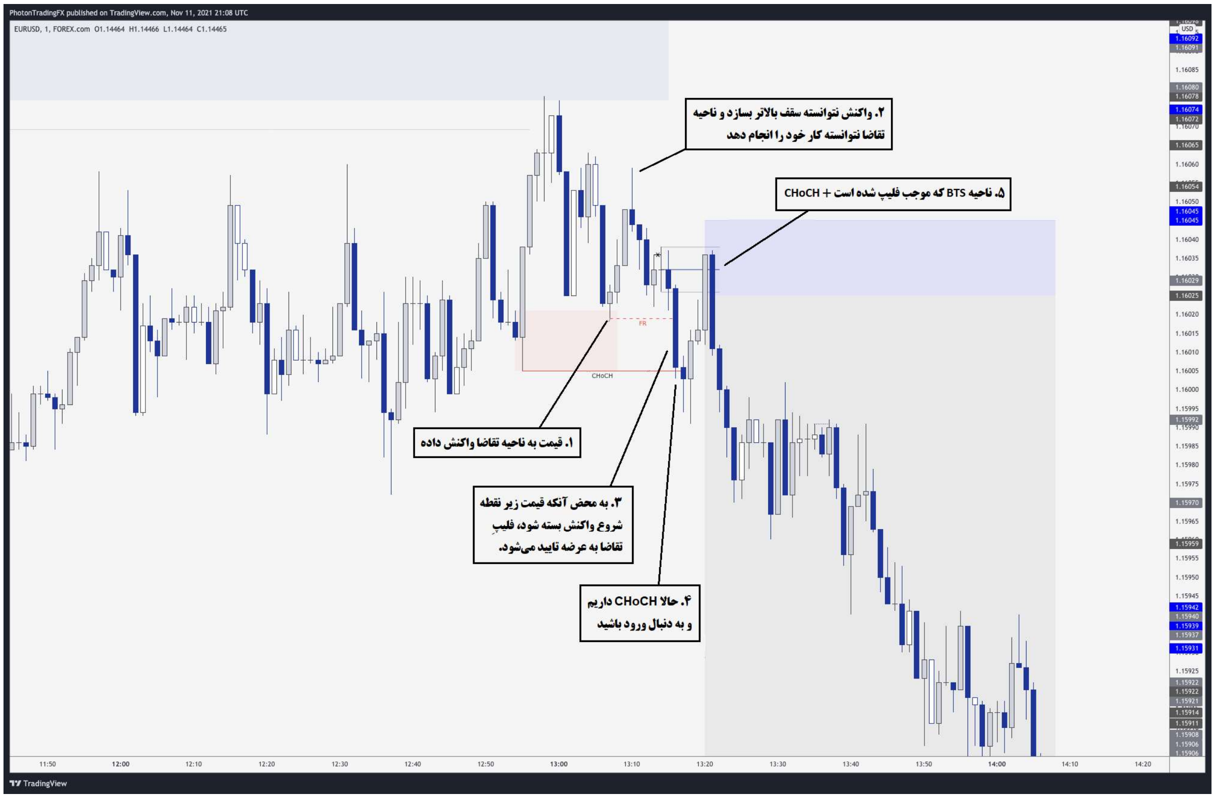


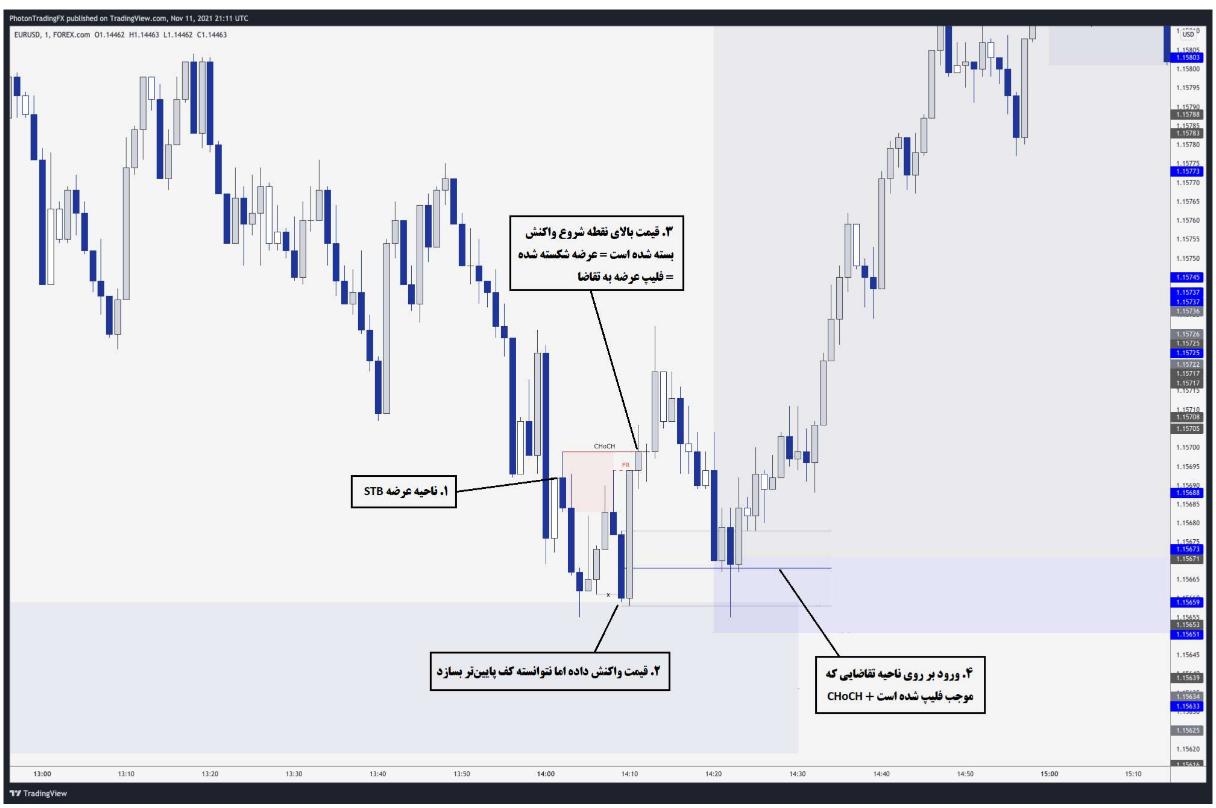



PhotonTradingFX published on TradingView.com, September 03, 2021 14:18:40 BST
FOREXCOM:EURUSD, 1
ساختار مولتی تایم‌فریمِ بازار با نواحی عرضه و تقاضای فلیپ
جریان سفارشات فرکتالی مورد انتظار
یک حرکت کوچک در تایم‌فریم بالاتر، یک روند در تایم‌فریم پایین‌تر است
4H
M15
M1
BOS
CHoCH
FR
TradingView


PhotonTradingFX published on TradingView.com, September 03, 2021 14:33:50 BST
FOREXCOM:EURUSD, 1 1.18995 +0.00243 (+0.2%) O:1.18986 H:1.18998 L:1.18982 C:1.18997
ساختار مولتی تایم‌فریمِ بازار با نواحی عرضه و تقاضای فلیپ
جریان سفارشات فرکتالی مورد انتظار
یک حرکت کوچک در تایم‌فریم بالاتر، یک روند در تایم‌فریم پایین‌تر است
4H
M15
M1
همیشه برای تعیین جهت کلی بازار از تایم‌فریم‌های بالاتر شروع کنید.
کار خود را تا تایم‌فریم‌های پایین‌تر برای بهینه‌سازی و زمان‌بندی ورود ادامه دهید.
به دنبال نواحی بگردید که کنترل بازار بین نواحی عرضه و تقاضا تبادل شده است.
۱.
تایم ۴ ساعته صعودی است
عرضه نتوانسته کف پایین‌تر جدید بسازد
۲. فلیپ عرضه به تقاضا (S2D)
ناحیه تقاضای ۴ ساعته باعث
شکست عرضه شده است + BOS
۳.
بعد از شکست ساختار ۴ ساعته، انتظار پولبک در تایم ۴ ساعته داریم:
– مصرف شدن ناحیه عرضه
– CHoCH
– ناحیه تقاضا در منطقه ارزان لگ ۴ ساعته تارگت است.
۴. تقاضای ۱۵ دقیقه از ساخت
سقف بالاتر ناتوان بوده است
۵. فلیپ تقاضا به عرضه (D2S)
ناحیه عرضه باعث شکست تقاضا
شده است + CHoCH
۶. ناحیه تقاضایِ اکستریم ۴ ساعته مصرف شده است
اگر روند نزولی ۴ ساعته می‌خواهد ادامه پیدا کند، آخرین ناحیه باید قیمت را نگه دارد.
انتظار تشکیل کف بالاتر داریم.
برای تاییدیه منتظر CHoCH تایم ۱۵ دقیقه باشید.
۷. ناحیه عرضه ۱۵ دقیقه
نتوانسته کف پایین‌تر بسازد.
۸. فلیپ عرضه به تقاضا (S2D)
ناحیه تقاضا باعث شکست عرضه
شده است + CHoCH
۹. قیمت به منطقه ارزان ۱۵ دقیقه وناحیه تقاضا پولبک
زده و شانس تشکیل کف بالاترِ تایم ۱۵ دقیقه افزایش
یافته است.
برای تاییدیه منتظر CHoCH تایم ۱ دقیقه باشد
۱۰. ناحیه عرضه ۱ دقیقه نتوانسته
کف پایین‌تر جدید بسازد
۱۱.
فلیپ عرضه به تقاضای ۱ دقیقه + CHoCH
باتوجه به تایم‌فریم بالاتر سوینگ سقفِ ضعیفِ ۴ ساعته
تارگت است.
BOS / FR
BOS
CHoCH
FR
TradingView

مثال:

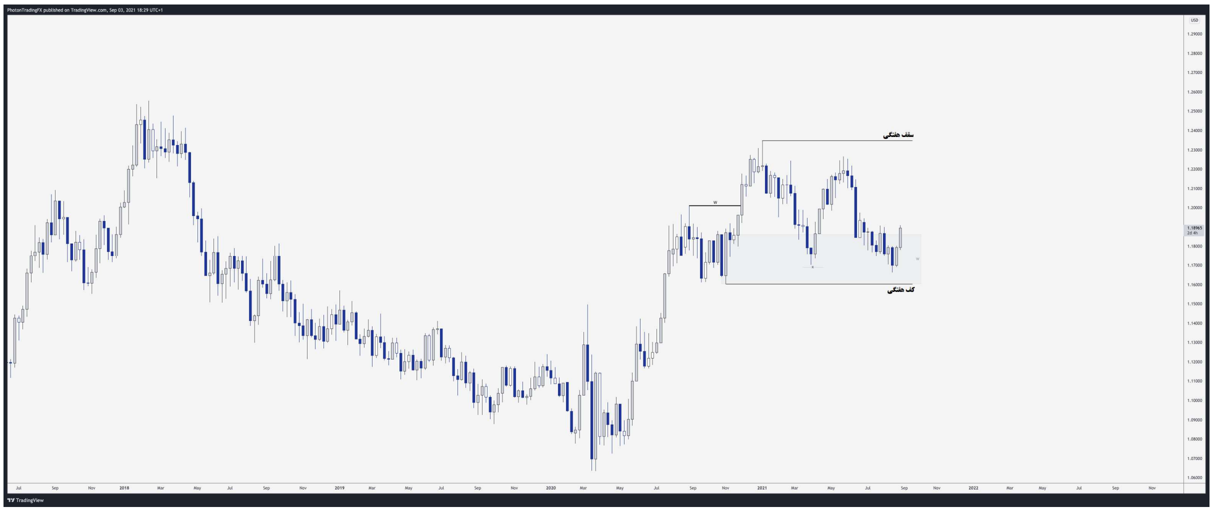

EURUSD, 1, FOREX.com
۲. واکنش نتوانسته سقف بالاتر بسازد و ناحیه تقاضا نتوانسته کار خود را انجام دهد
۵. ناحیه BTS که موجب فلیپ شده است + CHoCH
CHoCH
۱. قیمت به ناحیه تقاضا واکنش داده
۳. به محض آنکه قیمت زیر نقطه شروع واکنش بسته شود، فلیپ تقاضا به عرضه تایید می‌شود.
۴. حالا CHoCH داریم و به دنبال ورود باشید
TradingView


EURUSD, 1, FOREX.com
۳. قیمت بالای نقطه شروع واکنش بسته شده است = عرضه شکسته شده = فلیپ عرضه به تقاضا
CHoCH
۱. ناحیه عرضه STB
۲. قیمت واکنش داده اما نتوانسته کف پایین‌تر بسازد
۴. ورود بر روی ناحیه تقاضایی که موجب فلیپ شده است + CHoCH
TradingView

مثال ترید ۱:

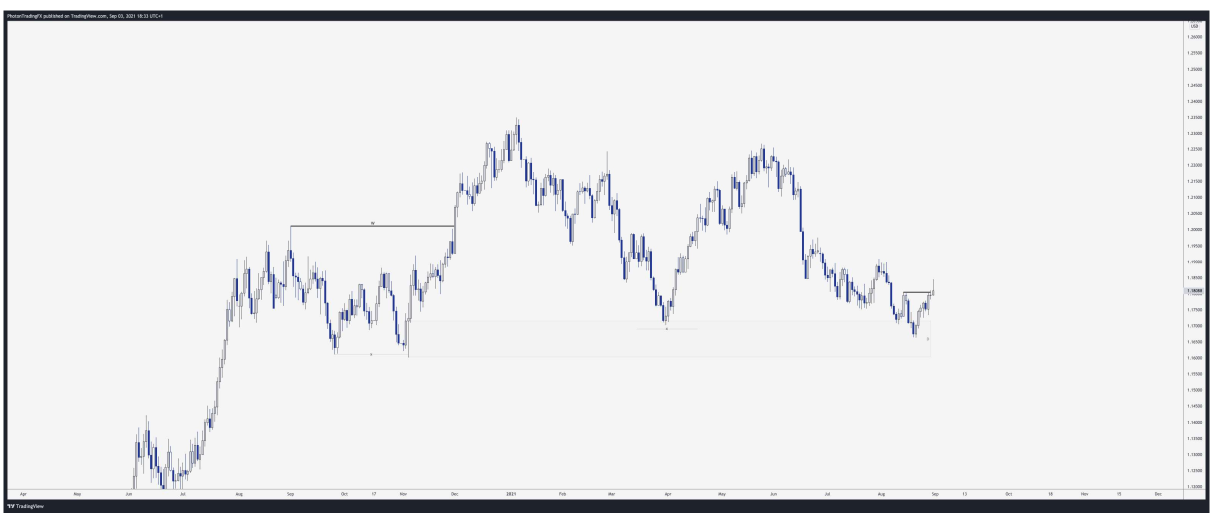
هفتگی

در تایم هفتگی قیمت داخل ناحیه تقاضای اکستریمِ رنجِ صعودی است و نقدینگی کفِ داخلیِ ماژور جمع‌آوری شده است. انتظار داریم تشکیل سقف بالاترِ هفتگی از اینجا شروع شود، در غیر این صورت احتمالا ناحیه رنج به سمت پایین شکسته خواهد شد.



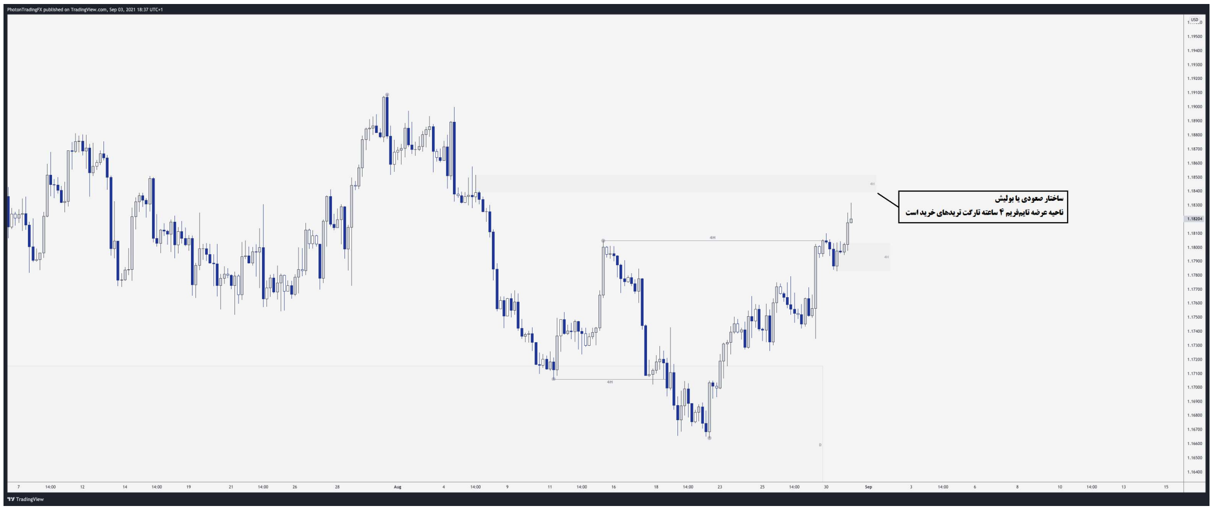
روزانه

در تایم‌فریم روزانه قیمت بعد از واکنش به سطح تعادلیِ (وسط / EQ) ناحیه تقاضا، تغییر ماهیت صعودی داده است.



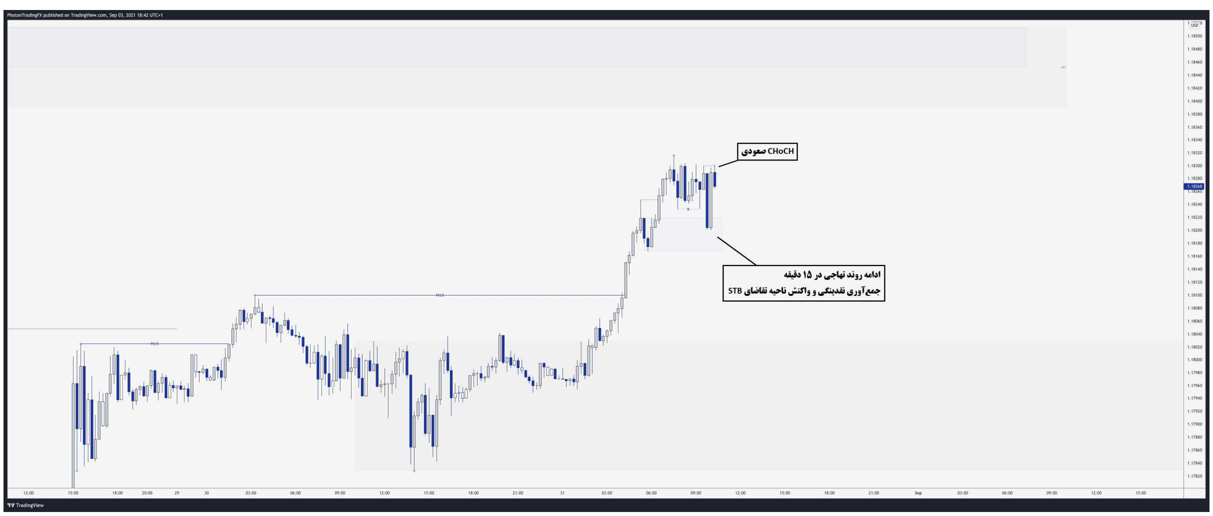
۴ ساعته

در تایم‌فریم ۴ ساعته ساختار صعودی است. انتظار داریم که بعد از آخرین شکست ساختار پولبک داشته باشیم، بنابراین نزدیک‌ترین ناحیه عرضه ۴ ساعته تارگت است.



۱۵ دقیقه

ساختار تایم‌فریم ۱۵ دقیقه صعودی است اما قیمت خیلی بالای لگ است و برای خرید جای بسیار پر ریسک و تهاجمی است. نقدینگی کف‌های برابر (EQL) جمع‌آوری شده و همچنین واکنش قوی به ناحیه تقاضا موجب CHoCH شده است.



۱ دقیقه

قیمت به سمت ناحیه تقاضای منشا حرکت اصلاحی داشته است. ستاپ CHoCH + فلیپ داریم پس می‌توانیم ورود کنیم. ناحیه تا سایه‌های STB بهینه شده است که در تایم‌فریم ۱۵ ثانیه ناحیه تقاضا می‌باشد (آخرین ناحیه تقاضا که منجر به شکست ناحیه عرضه شده است).



۱۵ ثانیه

در این تایم‌فریم به وضوح می‌بینید که بهینه‌سازی فرکتالی در تایم‌فریم ۱ دقیقه چه چیزی بوده است.

ناحیه پیوت تقاضای STB سبب CHoCH و فلیپ شده است.



<u>تارگت</u>

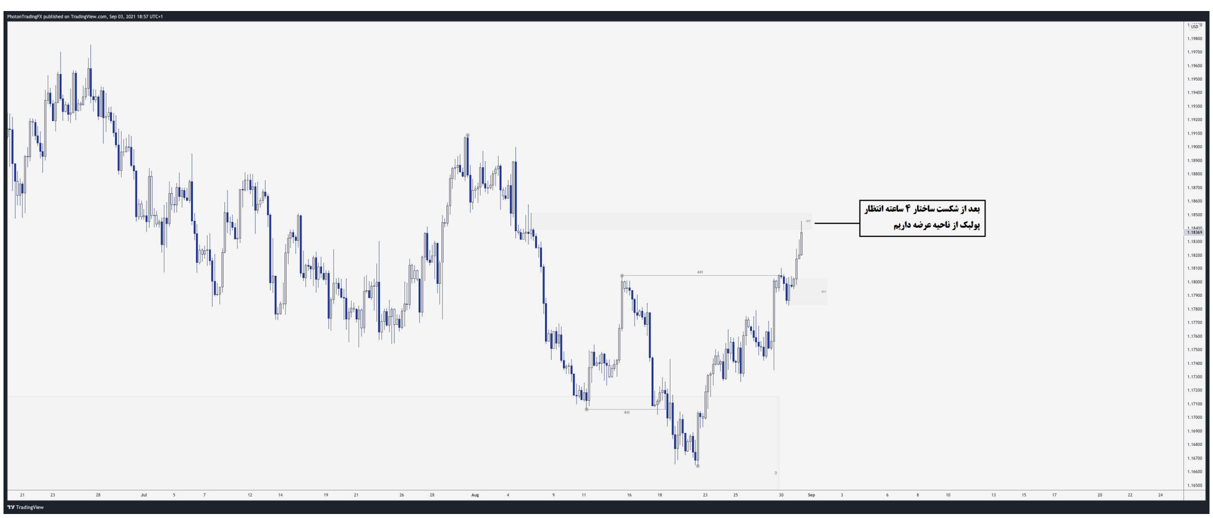
ناحیه عرضه ۱۵ دقیقه که با ناحیه عرضه ۴ ساعته همپوشانی دارد و نسبت ریوارد به ریسک آن ۱۱ است.



مثال ترید ۲:

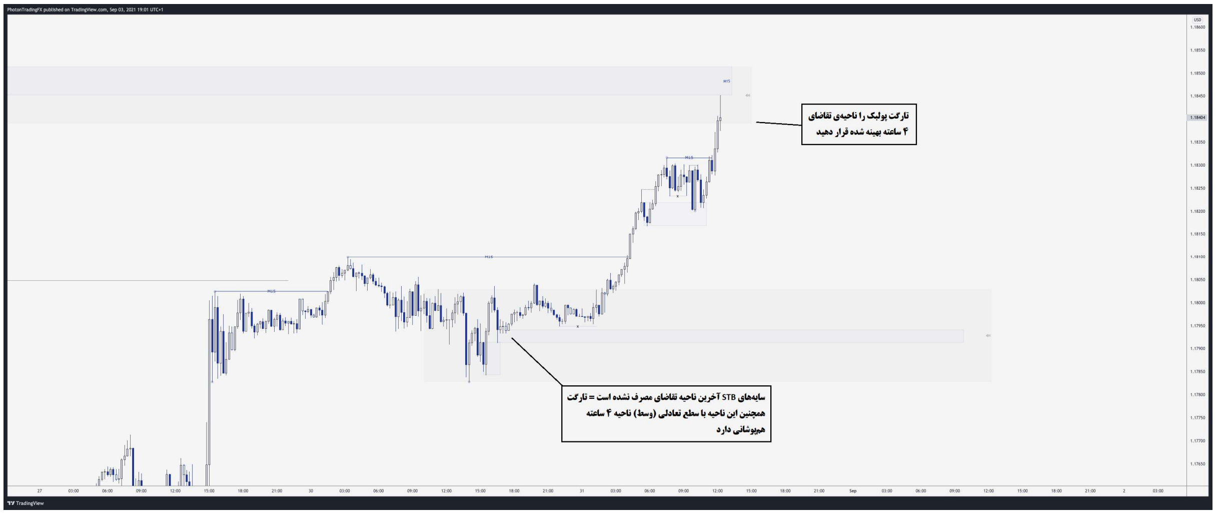
<u>۴ ساعته</u>

قیمت به شدت به ناحیه عرضه ۴ ساعته واکنش داده و به احتمال زیاد پولبک ۴ ساعته در حال شروع شدن است.



۱۵ دقیقه

ناحیه تقاضای ۴ ساعته و ناحیه بهینه ۱۵ دقیقه‌ی درون آن را به‌عنوان تارگت پولبک در نظر می‌گیریم.



۱ دقیقه

ورود بسیار تهاجمی چون خلاف روند تایم‌فریم بالاتر است. ورود ایمن‌تر صبر برای مشاهده یک CHoCH در ۱۵ دقیقه می‌باشد. اگرچه که این ناحیه عرضه، آخرین ناحیه‌ای است که می‌تواند قیمت را برای بازگشت/پولبک نگه دارد.

حرکت واضح و قوی نزولی بعد از مصرف شدن ناحیه عرضه و حرکت پولبک آرام بعد از آن نشانه سفارشات فروش سنگین است. حرکات قیمت در تایم‌فریم ۱ دقیقه نشان‌دهنده ChoCH + Flip است.



۱۵ ثانیه

مجدد Flip+CHoCH و تکرار کارهای گذشته.



اضافه کردن به پوزیشن (Scale in)

مصرف شدن نواحی پشت سر هم نشان‌دهنده جریان سفارشات نزولی است که می‌توان از آن‌ها برای ورود مجدد و اضافه کردن حجم به پوزیشن استفاده کرد. برای این منظور منتظر ناحیه فلیپ D2S بعدی در ۱ دقیقه باشید تا ورود با شانس برد بالاتری باشد.



هج کردن (Hedge)

پس از جمع‌آوری نقدینگیِ سویینگ کفِ تایم‌فریم ۱۵ دقیقه، می‌توانیم پوزیشن هج در جهت خرید باز کنیم.

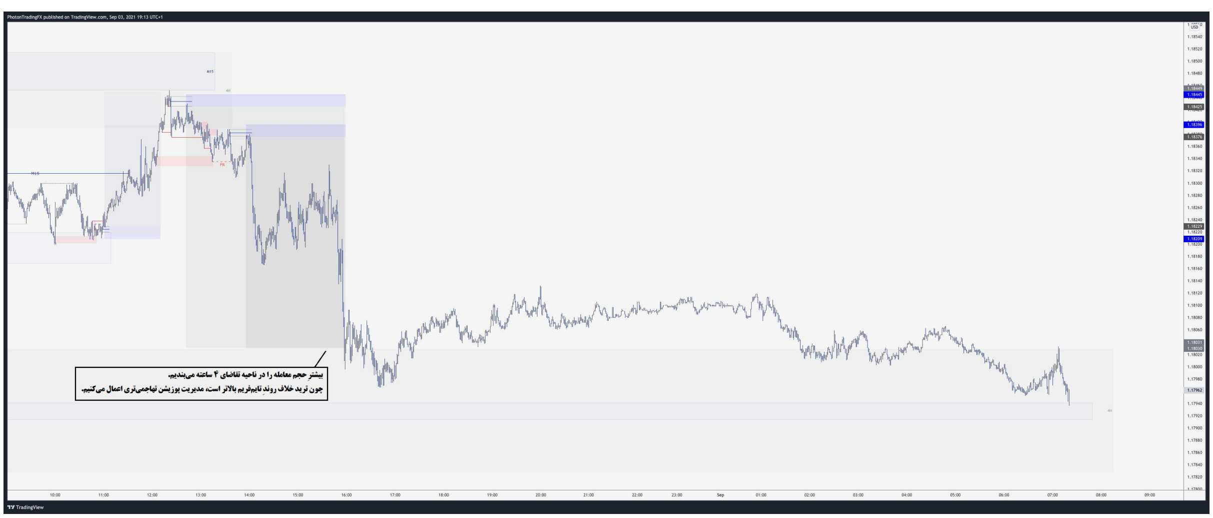
ورود بر روی ناحیه فلیپ (بدون مشاهده CHoCH = بسیار تهاجمی) و تارگت در ریوارد ۵ می‌باشد.



تارگت

در تریدهای خلاف روند مدیریت پوزیشن سفت و سخت‌تری داشته باشید.

ناحیه تقاضای ۴ ساعته بعدی را تارگت قرار دهید. به این ترتیب ترید اول ریوارد ۲۰ و ترید Scale in ریوارد ۱۷/۵ دارد.



مثال ترید ۳:

۴ ساعته

ساختار صعودی است و اکنون بعد از جمع‌آوری نقدینگی قیمت به ناحیه تقاضا پولبک زده است؛ بنابراین احتمال دارد کف بالاتر تشکیل شود.



۱۵ دقیقه

بعد از مصرف شدن ناحیه تقاضا CHoCH تایم‌فریم ۱۵ دقیقه تشکیل شده و با قدرت سه ناحیه را شکسته است.

شروع سشن لندن حجم معاملات بالاست.

هدف ما ورود در کف بالاترِ داخلی در تایم‌فریم ۱۵ دقیقه است و پیش‌بینی می‌کنیم که روند ۱۵ دقیقه به صعودی تغییر کند و کف بالاتر ۴ ساعته تشکیل شود.



۱ دقیقه

در یک دقیقه ستاپ Flip+CHoCH داریم.

آخرین ناحیه تقاضا باید قیمت را نگه دارد، در غیر این صورت کل ایده ما اشتباه است.



اضافه کردن به پوزیشن (Scale in)

در تایم‌فریم پایین‌تر Flip+CHoCH داریم. این اضافه کردن به پوزیشن تهاجمی و پرریسک است چون قیمت نسبت به لگ تایم‌فریم ۱ دقیقه بالاست؛ اما هدف شما ورود در کف بالاتر ۴ ساعته و خروج در سقف بالاتر ۴ ساعته می‌باشد و به این ترتیب درصورت موفقیت، نسبت ریوارد به ریسک بسیار بالاست.



تارگت‌ها

تارگت اول ← سقف ضعیف ۴ ساعته

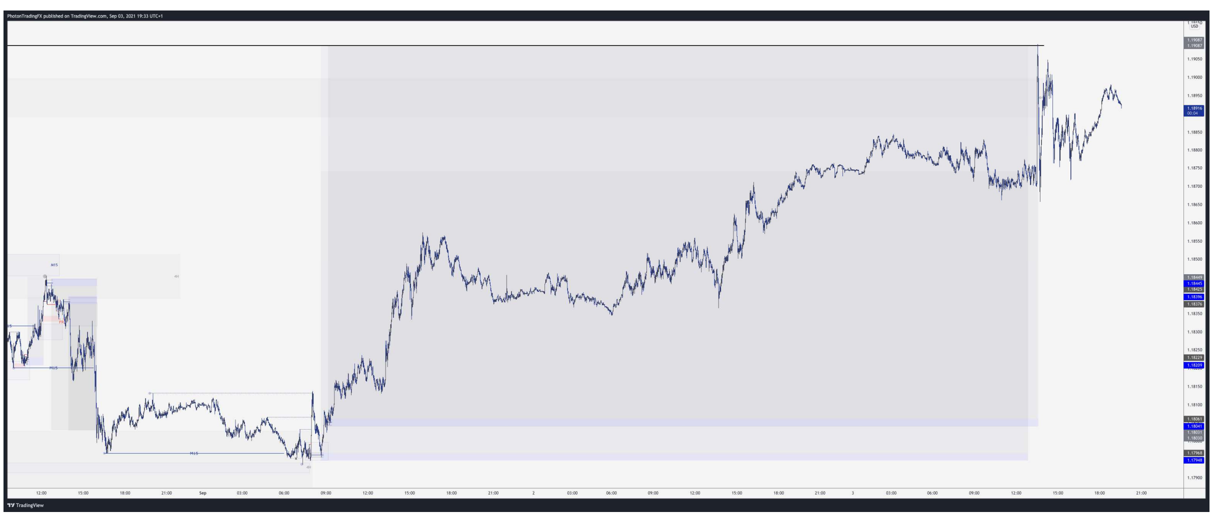
تارگت اول ← عرضه ۴ ساعته

تارگت اول ← سقف روزانه



نتیجه

اگر تارگت کامل در سقف روزانه گرفته شود، ترید سوم ریسک به ریوارد ۵۶ و ترید اضافه شده (Scale in) ریسک به ریوارد ۵۱ خواهد داشت.



فصل سوم:

نقدینگی

مفهوم نقدینگی

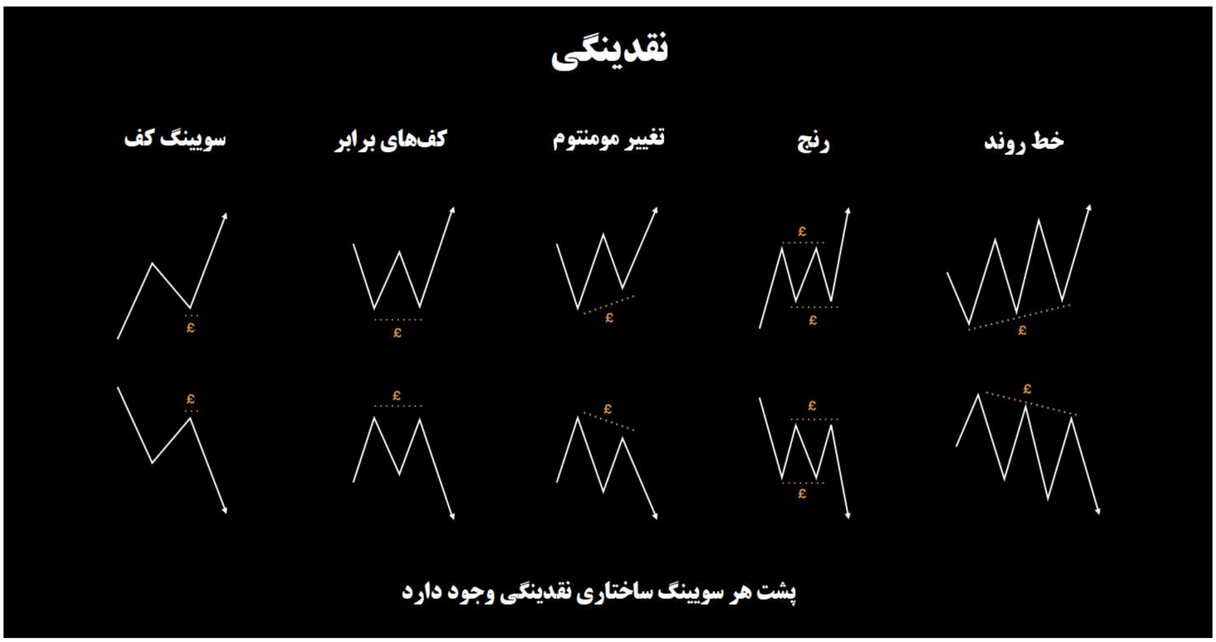
نقدینگی بازار عبارت است از:

- میزان عرضه و تقاضا در یک بازار
- سهولت در معامله در یک بازار بدون اثرگذاری بر روی قیمت

برای هر سفارش خرید، باید سفارش فروشی دقیقا به اندازه سفارش خرید وجود داشته باشد تا معامله انجام شود (و بالعکس).

قیمت به صورت مستمر به دنبال استخرهای نقدینگی (سفارشات) برای رسیدن به تعادل است.

مفهوم نقدینگی یک ابزار تحلیل برای تعیین محل استخرهای نقدینگی است. نقدینگی مانند آهنربا قیمت را به خود جذب می‌کند چون بازار به دنبال نقدینگی برای رسیدن به تعادل و سوخت لازم برای ادامه حرکت است.



دو روش برای استفاده از نقدینگی در بهینه‌سازی نواحی عرضه و تقاضا وجود دارد:

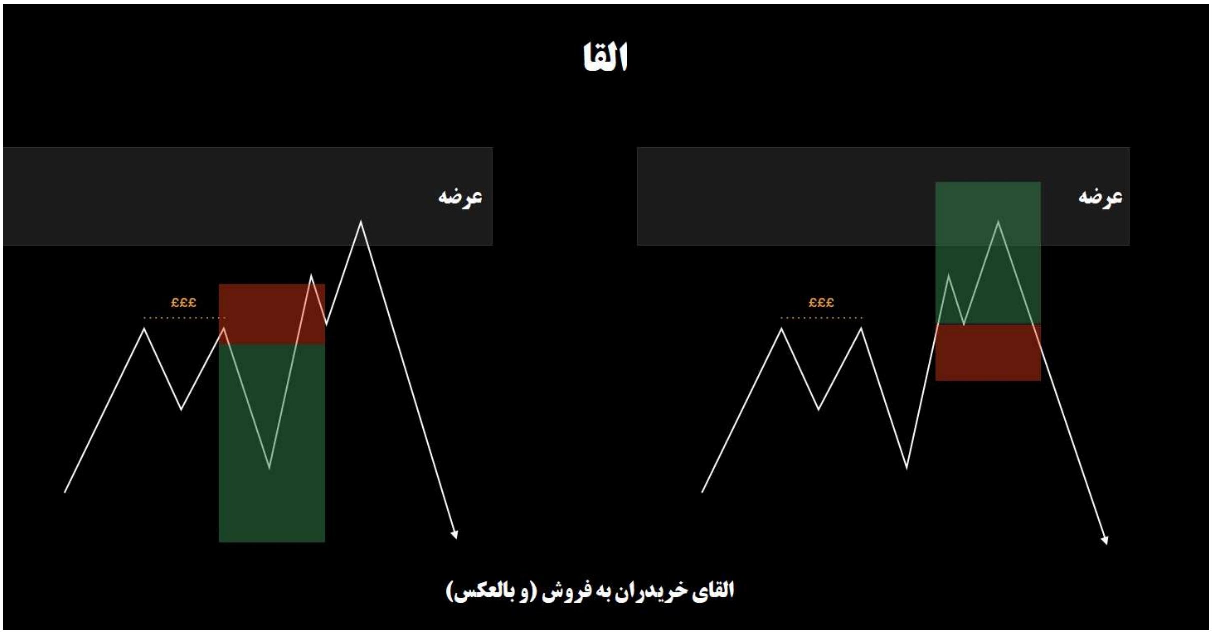
۱. القا[۱] ← القای معامله‌گران بازار به ترید در جهت مخالف (اشتباه).

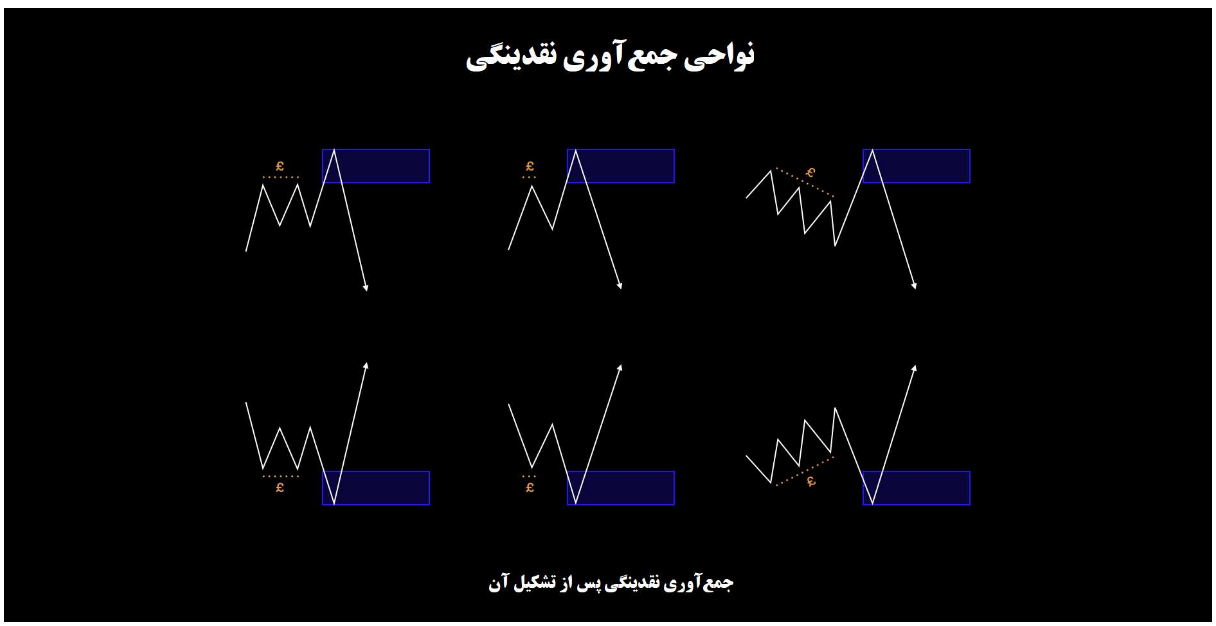
۲- نواحی که نقدینگی جمع‌آوری کرده‌اند[۲] ← زمانی که نقدینگی ایجاد می‌شود سپس با یک حرکت جمع‌آوری می‌شود.

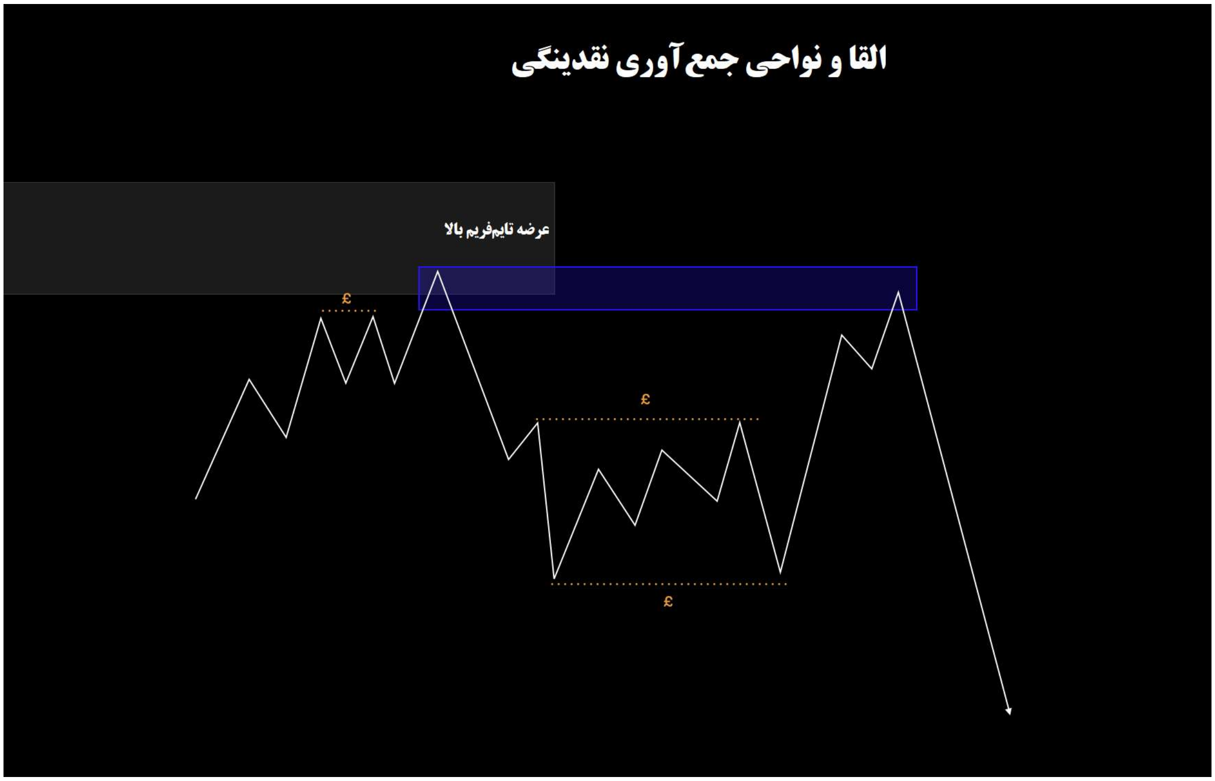
دو مورد بالا می‌توانند باهم تشکیل شوند، در ادامه برای هر حالت مثال آورده شده است.

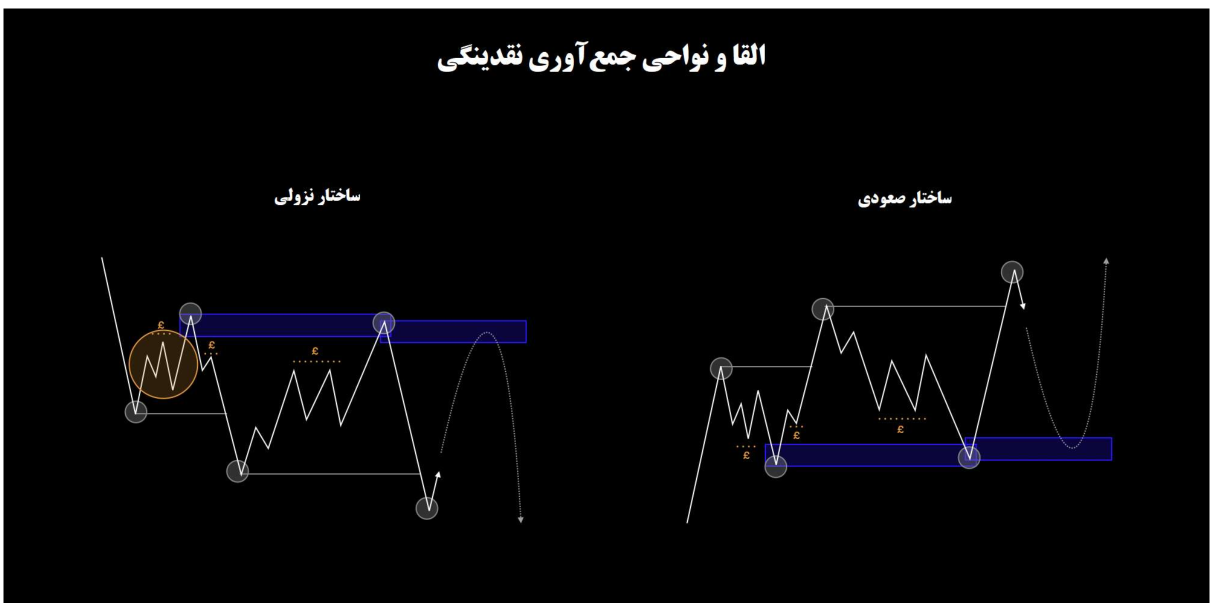
---

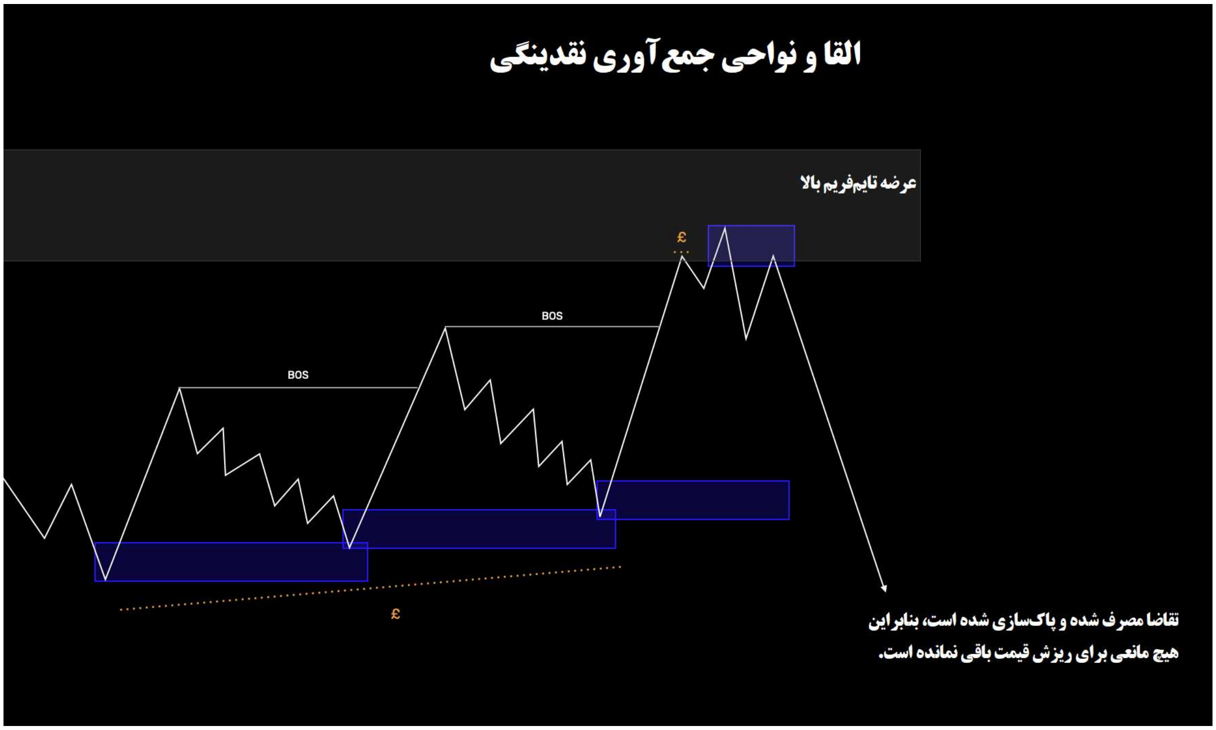
۱ Inducement
۲ Sweep zones


القا
عرضه
£££
عرضه
£££
القای خریدران به فروش (و بالعکس)

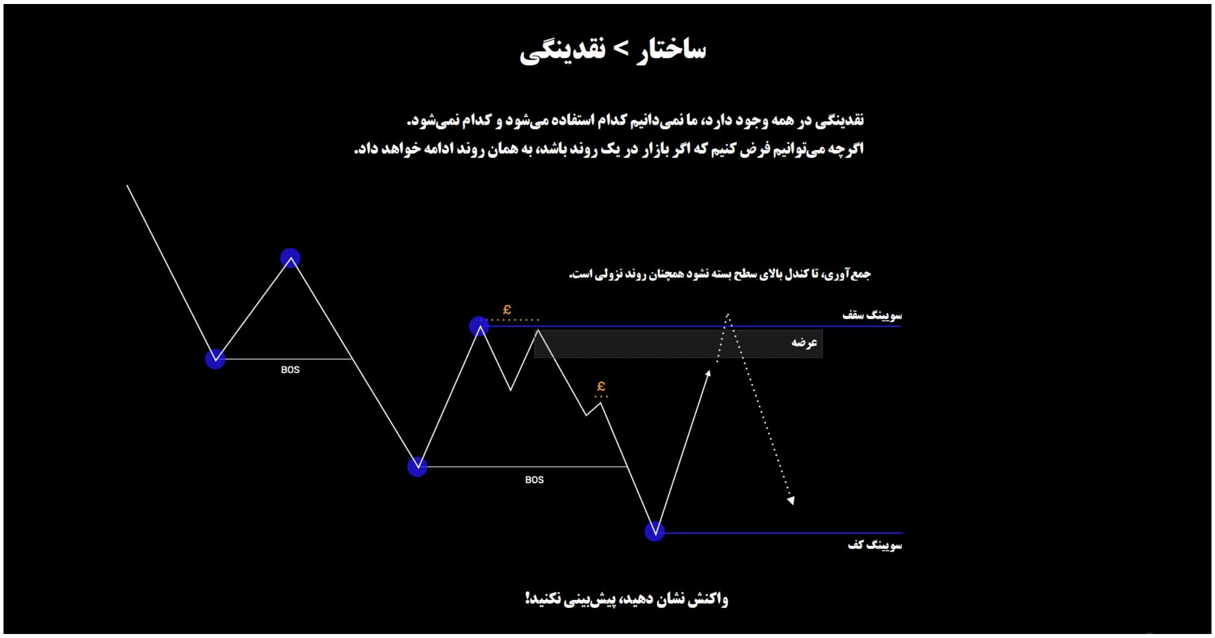

نواحی جمع‌آوری نقدینگی
£
£
£
£
£
£
جمع‌آوری نقدینگی پس از تشکیل آن


القا و نواحی جمع آوری نقدینگی
عرضه تایم‌فریم بالا
£
£
£

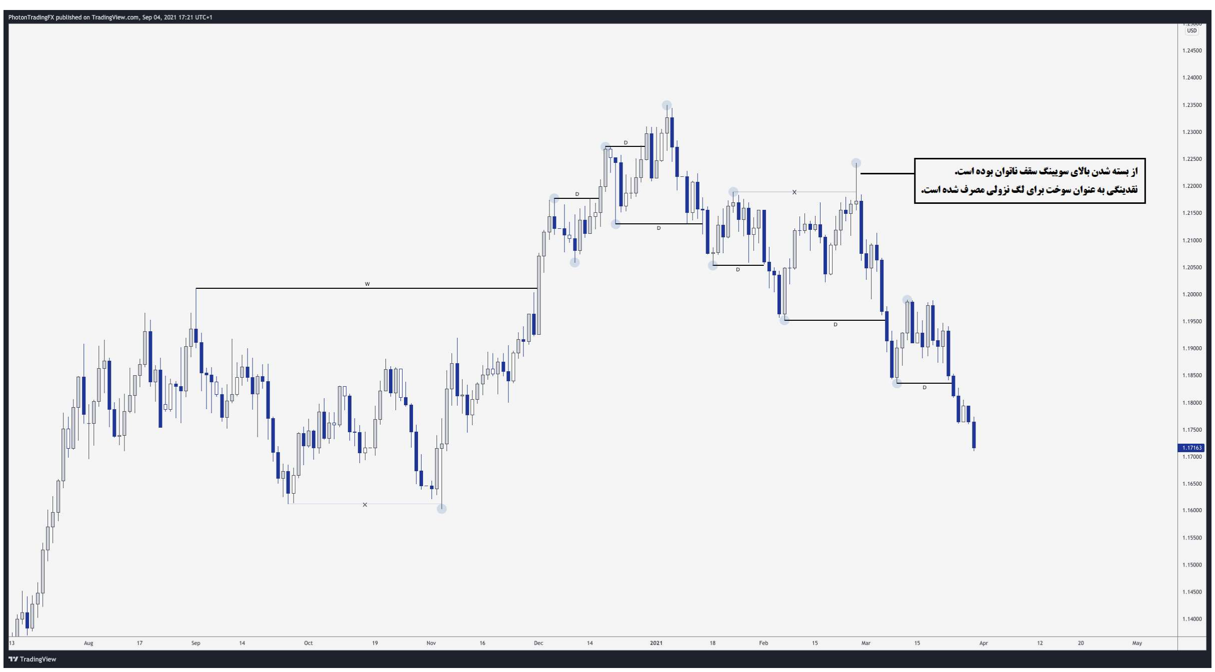

القا و نواحی جمع آوری نقدینگی
ساختار نزولی
ساختار صعودی


القا و نواحی جمع آوری نقدینگی
عرضه تایم‌فریم بالا
£
BOS
BOS
£
تقاضا مصرف شده و پاک‌سازی شده است، بنابراین
هیچ مانعی برای ریزش قیمت باقی نمانده است.

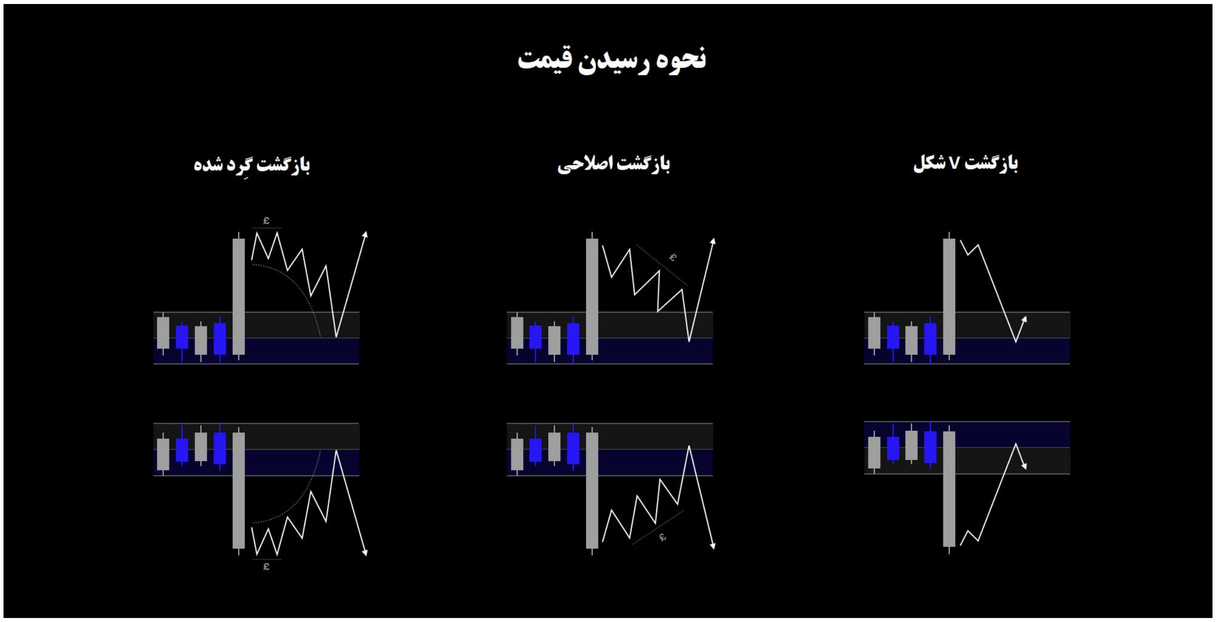
ساختار مهم‌تر از نقدینگی است



همیشه در خلاف جهت جمع‌آوری نقدینگی معامله کنید.



نحوه رسیدن قیمت



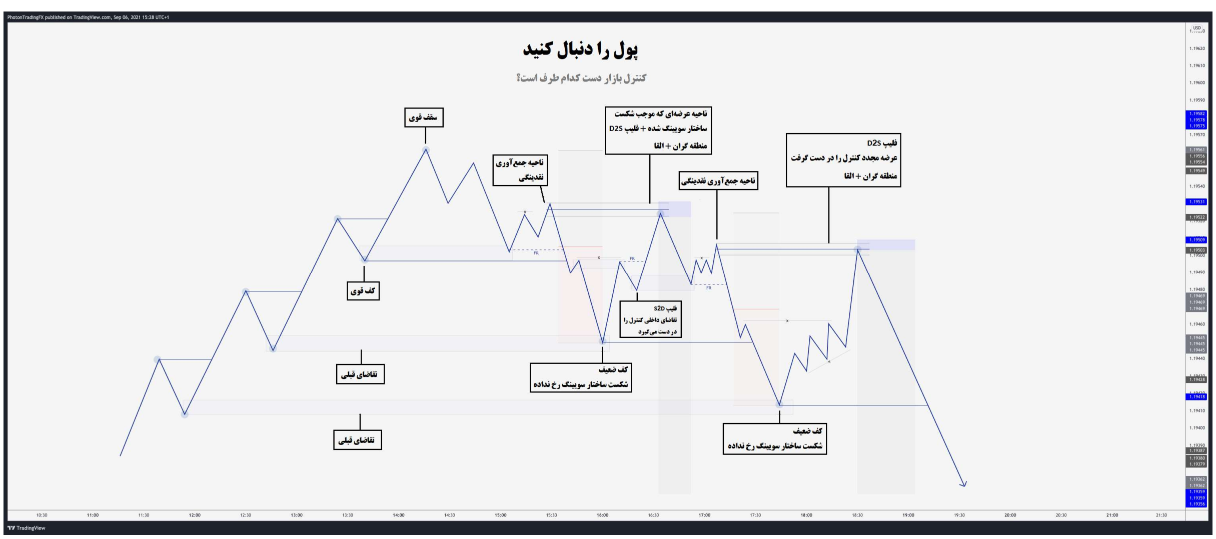
ساختار مولتی تایم‌فریم بازار به همراه نواحی عرضه و تقاضا و نقدینگی



مثال واقعی:



پول را دنبال کنید:



مثال از مبحث نقدینگی بر روی EURUSD

تایم فریم ۴ ساعته و داستان قیمت:

ساختار نزولی است و انتظار داریم که قیمت به ناحیه عرضه در منطقه گران پولبک بزند.

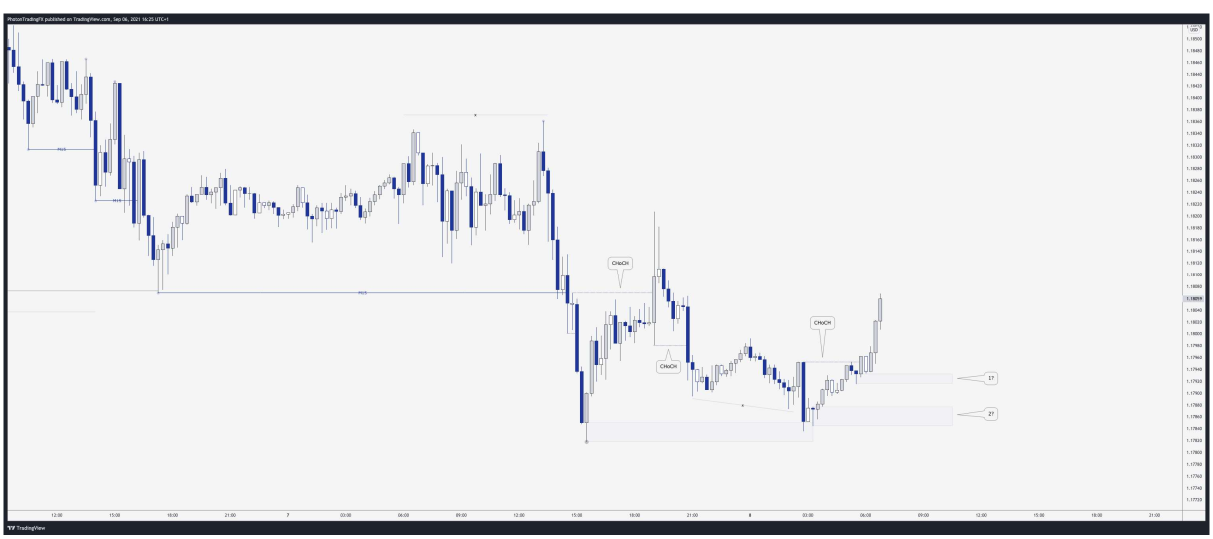


تایم‌فریم ۱۵ دقیقه [ترید اول] – کدام ناحیه؟

CHoCH در تایم‌فریم ۱۵ دقیقه سیگنال شروع پولبک در تایم‌فریم ۴ ساعته می‌باشد.

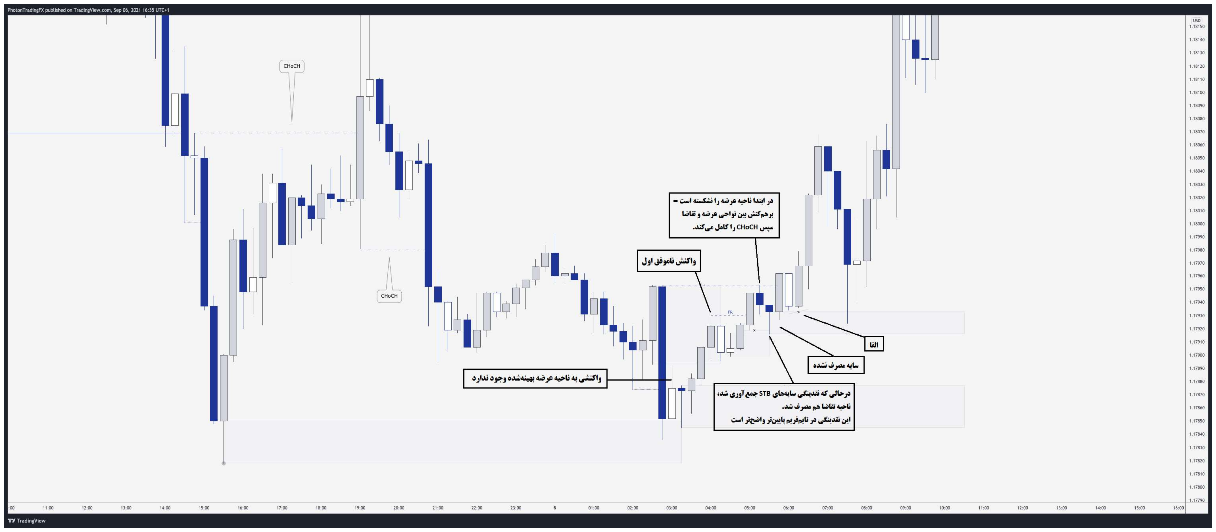
ساختار داخلی تایم‌فریم ۱۵ دقیقه مجددا باید نزولی شود (CHoCH) تا به ناحیه تقاضای مینور پولبک بزند. صبر کنید تا ناحیه تقاضای ۱۵ دقیقه مصرف شود و مجدد برای صعودی شدن CHoCH ساختار داخلی تشکیل شود.

چند ناحیه بالقوه (POI) برای ترید در جهت خرید داریم. از بهینه‌سازی بوسیله نقدینگی استفاده کنید تا نواحی را فیلتر کنید.



تایم‌فریم ۱۵ دقیقه [ترید اول] – بهینه‌سازی

ناحیه اول تقاضایی را که باعث واکنش ناموفق اولیه می‌شود را مصرف می‌کند (پول را دنبال کنید) و مسئول و منشا CHoCH می‌باشد. همچنین این ناحیه نقدینگیِ سایه‌های STB را جمع‌آوری کرده است.



تایم‌فریم ۱۵ دقیقه [ترید دوم] – کدام ناحیه؟

اکنون قیمت تا ناحیه عرضه در منطقه گران پولبک زده است. تایم‌فریم ۱۵ دقیقه به نزولی تغییر کرده که سیگنالی است مبنی بر احتمال تشکیل سقف پایین‌تر ۴ ساعته و آمادگی برای تارگتِ کف ضعیف و تشکیل یک سوییگِ کف پایین‌تر. کدام ناحیه POI تایم ۱۵ دقیقه مناسب است؟



تایم‌فریم ۱۵ دقیقه [ترید دوم] – بهینه‌سازی

ناحیه دوم نقدینگی سقف‌های برابر را جمع‌آوری کرده است. ناحیه اول یک حرکت تمیز است و در نزدیکی آن هیچ القایی وجود ندارد. نقدینگی جمع‌آوری نکرده است اما سقف‌های برابر به‌عنوان القا ساخته تا توسط ناحیه دوم جمع‌آوری شوند.



نتیجه دو ترید بالا مجموعا ریوارد ۵۸ بود.



همیشه خلاف جهت جمع‌آوری نقدینگی ترید کنید

روزانه

ساختار نزولی می‌باشد. قیمت به منطقه گران پولبک زده و نقدینگی جمع‌آوری کرده است. سقف پایین‌تر به‌صورت بالقوه تشکیل شده، بنابراین می‌توانیم سوییینگِ کفِ ضعیف را تارگت قرار دهیم.

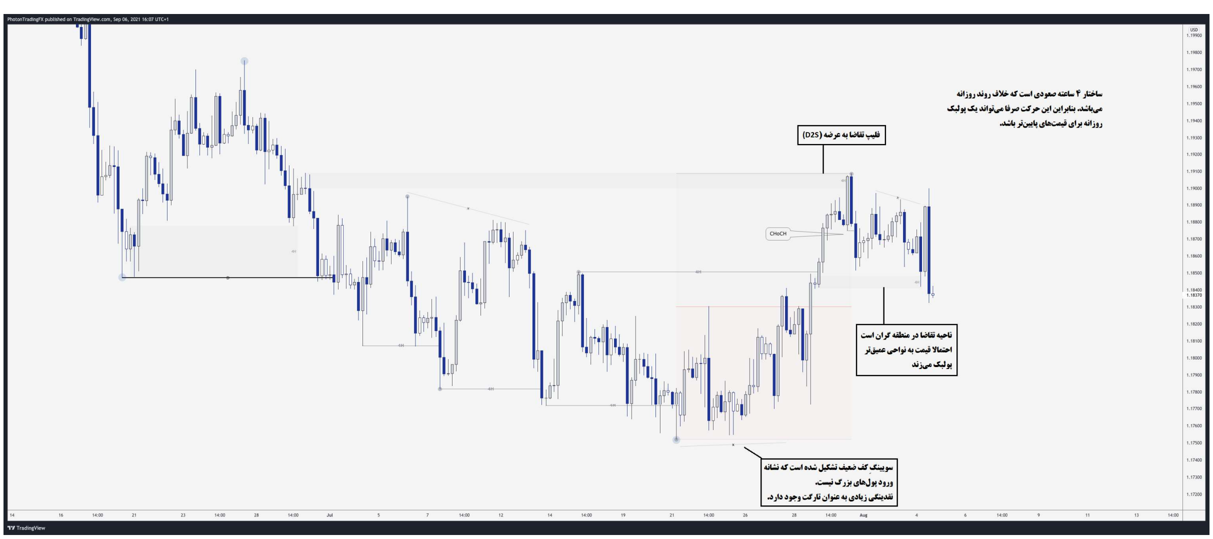


۴ ساعته:

ساختار تایم‌فریم ۴ ساعته صعودی اما ساختار روزانه نزولی است، بنابراین به احتمال زیاد به زودی روند ۴ ساعته معکوس می‌شود.

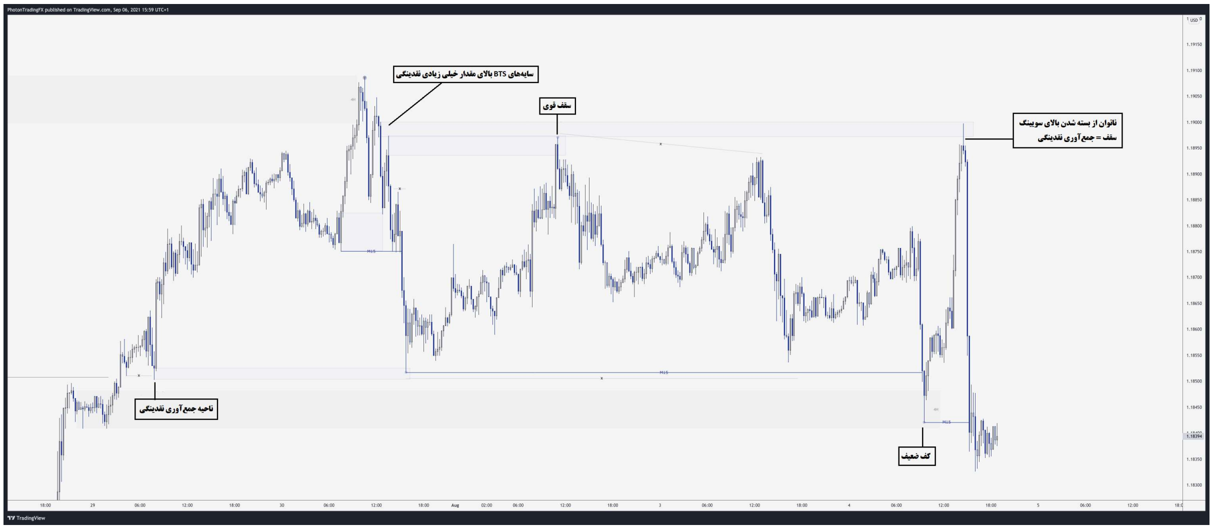
قیمت در حال واکنش به ناحیه تقاضای ۴ ساعته می‌باشد اما ناحیه در منطقه گران است و برای واکنش به ناحیه تقاضا در سطح قیمتی مناسبی نیست. بنابراین احتمالا قیمت می‌تواند تا سطوح پایین‌تر پولبک بزند یا معکوس شود.

سوییینگِ کفِ تایم‌فریم ۴ ساعته ضعیف تشکیل شده است. نقاط سوییینگ قوی معمولا شارپ و قوی هستند که نشانه ورود پول‌های بزرگ است.



۱۵ دقیقه:

قیمت تلاش کرده با شکست سوینگ سقف، تشکیل یک سقف بالاتر دهد. اما قیمت توسط سایه‌های BTS ریجکت شده و کندل مجدد درون رنج بسته شده است (شکست ساختار رخ نداده است). این سیگنالی است مبنی بر اینکه صرفا جمع‌آوری نقدینگی بوده و الان کفِ تایم‌فریم ۱۵ دقیقه ضعیف است چون نتوانسته سقف بالاتر بسازد.



۱ دقیقه:

جمع‌آوری نقدینگی ← مصرف شدن ← CHoCH ← فلیپ ← ورود



فصل چهارم:

انواع ورود

و

مدیریت معاملات

انواع ورود

دیدگاه ترید باید بر اساس موارد زیر باشد:

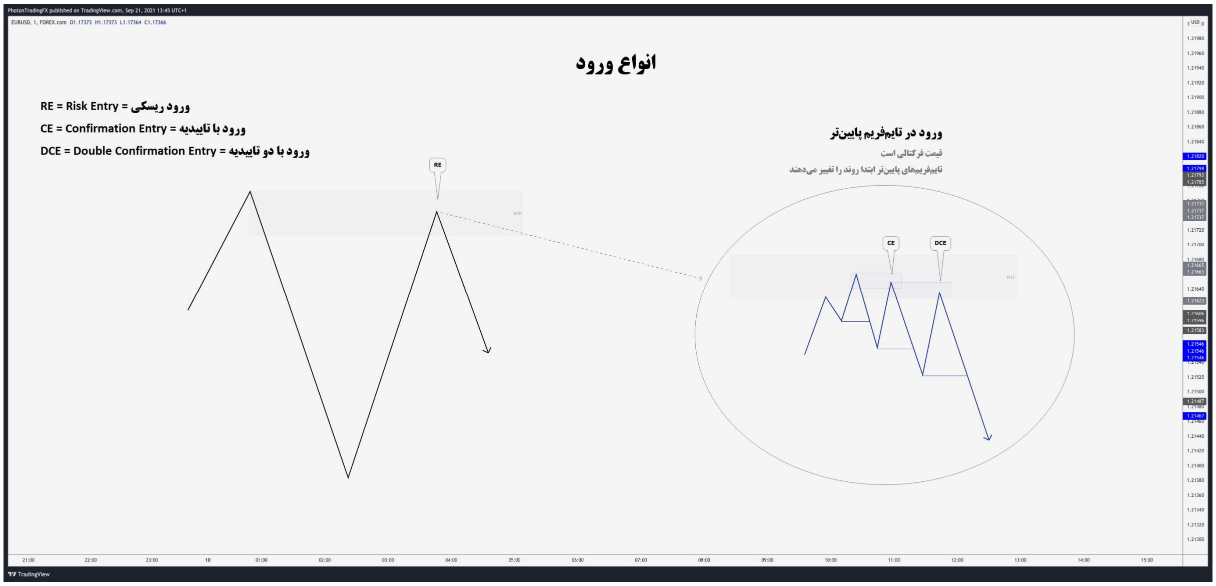
۱. ساختار بازار

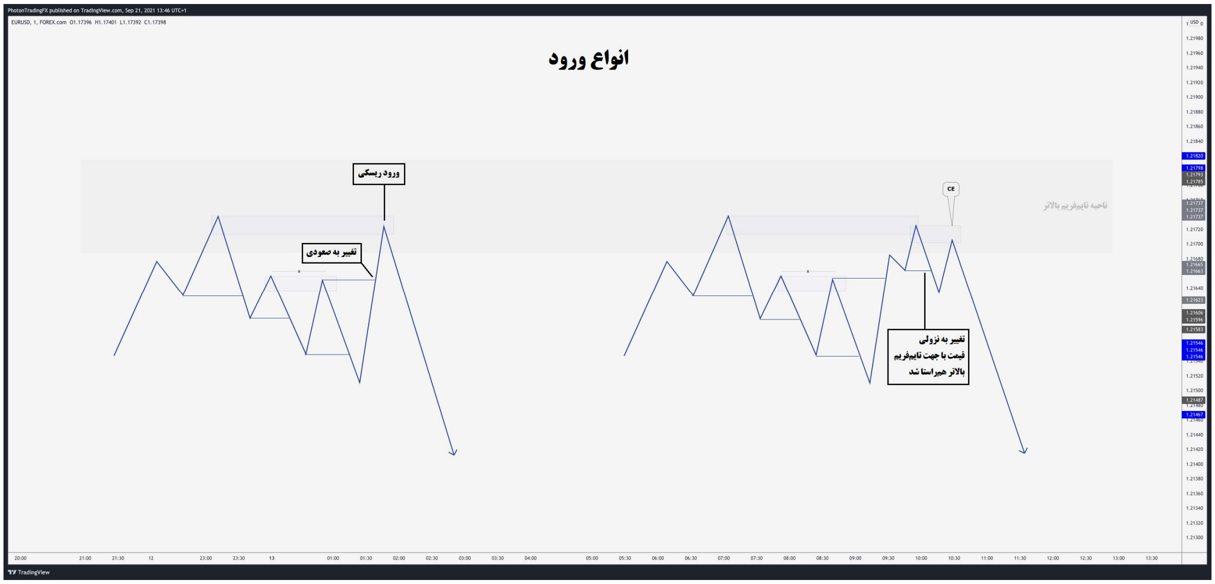
۲. نواحی عرضه و تقاضا

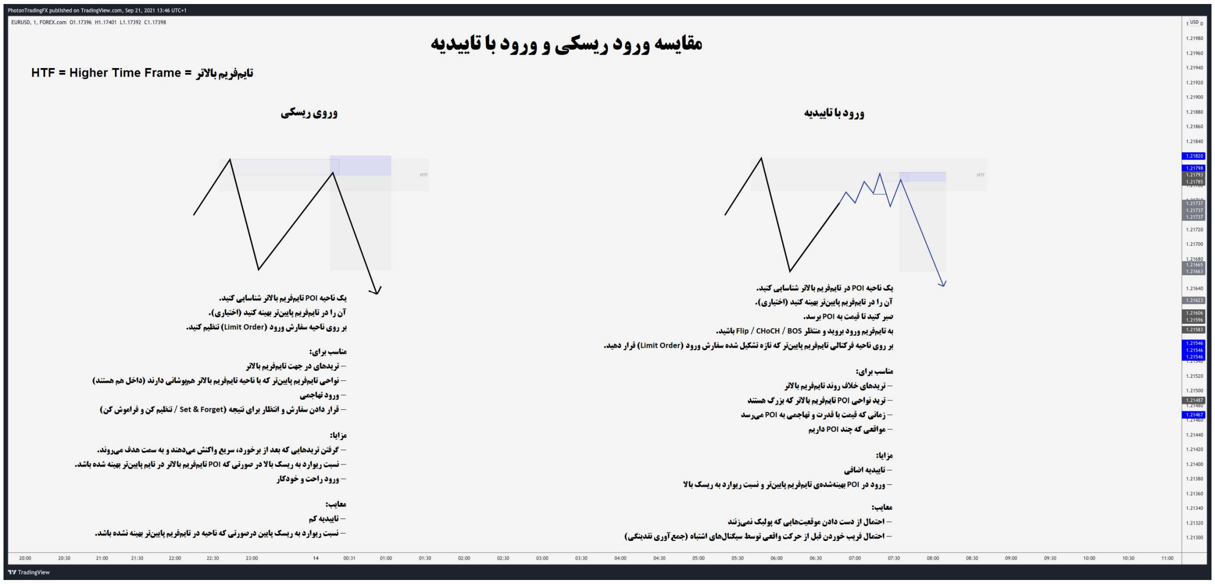
۳. نقدینگی

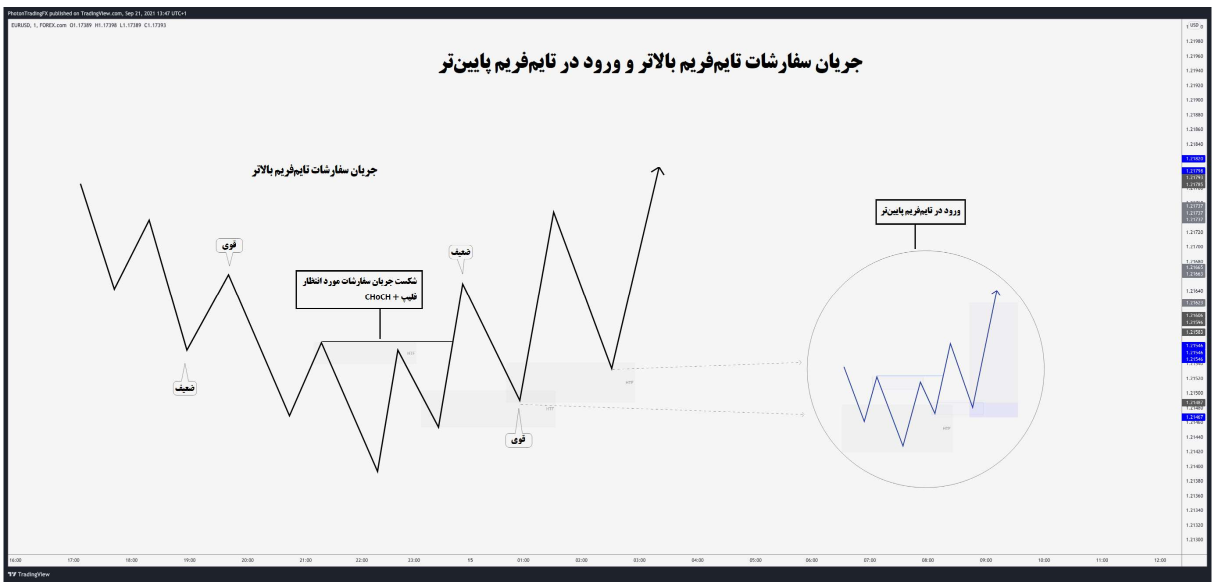
۴. قیمت‌گذاری (گران / ارزان)

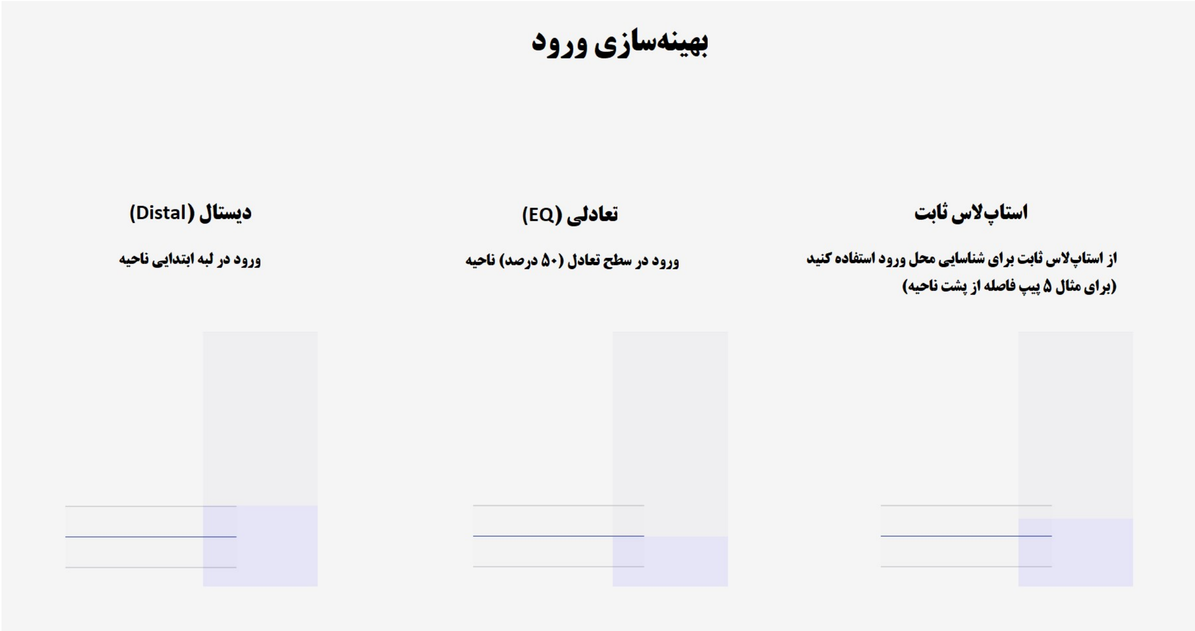
ترتیب اهمیت آن‌ها هم مانند بالاست.





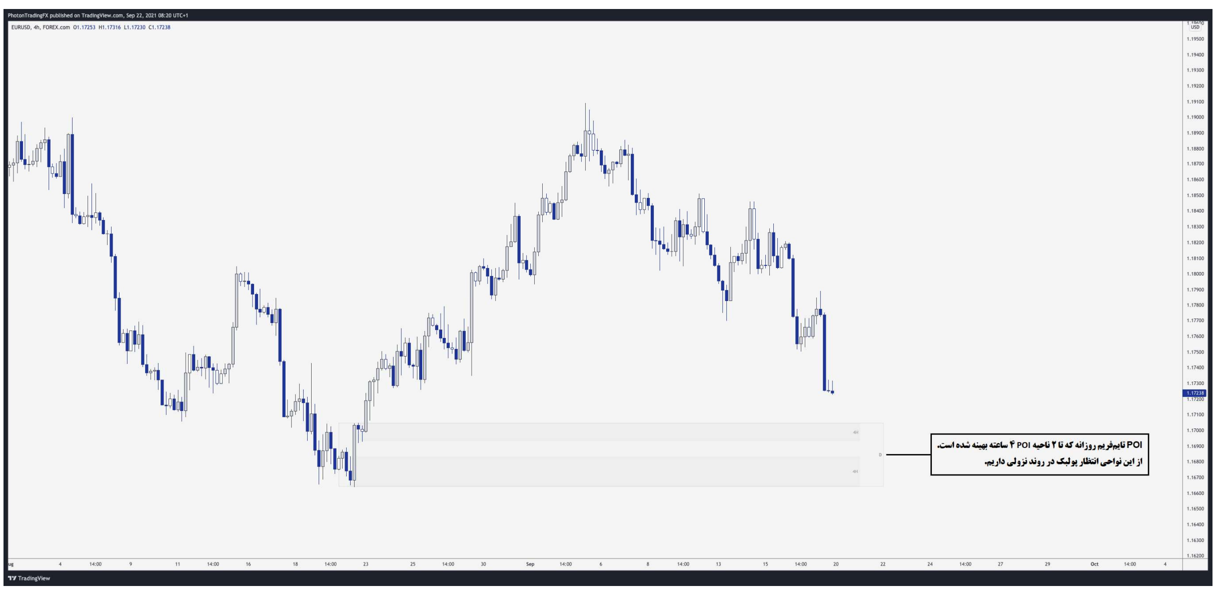

مقایسه ورود ریسکی و ورود با تاییدیه
HTF = Higher Time Frame = تایم‌فریم بالاتر
ورود با تاییدیه
یک ناحیه POI در تایم‌فریم بالاتر شناسایی کنید.
آن را در تایم‌فریم پایین‌تر بهینه کنید (اختیاری).
صبر کنید تا قیمت به POI برسد.
به تایم‌فریم ورود بروید و منتظر Flip / CHoCH / BOS باشید.
بر روی ناحیه فرکتالی تایم‌فریم پایین‌تر که تازه تشکیل شده سفارش ورود (Limit Order) قرار دهید.
مناسب برای:
– تریدهای خلاف روند تایم‌فریم بالاتر
– ترید نواحی POI تایم‌فریم بالاتر که بزرگ هستند
– زمانی که قیمت با قدرت و تهاجمی به POI می‌رسد
– مواقعی که چند POI داریم
مزایا:
– تاییدیه اضافی
– ورود در POI بهینه‌شده‌ی تایم‌فریم پایین‌تر و نسبت ریوارد به ریسک بالا
معایب:
– احتمال از دست دادن موقعیت‌هایی که پولبک نمی‌زنند
– احتمال فریب خوردن قبل از حرکت واقعی توسط سیگنال‌های اشتباه (جمع آوری نقدینگی)
ورود ریسکی
یک ناحیه POI تایم‌فریم بالاتر شناسایی کنید.
آن را در تایم‌فریم پایین‌تر بهینه کنید (اختیاری).
بر روی ناحیه سفارش ورود (Limit Order) تنظیم کنید.
مناسب برای:
– تریدهای در جهت تایم‌فریم بالاتر
– نواحی تایم‌فریم پایین‌تر که با ناحیه تایم‌فریم بالاتر هم‌پوشانی دارند (داخل هم هستند)
– ورود تهاجمی
– قرار دادن سفارش و انتظار برای نتیجه (Set & Forget / تنظیم کن و فراموش کن)
مزایا:
– گرفتن تریدهایی که بعد از برخورد، سریع واکنش می‌دهند و به سمت هدف می‌روند.
– نسبت ریوارد به ریسک بالا در صورتی که POI تایم‌فریم بالاتر در تایم پایین‌تر بهینه شده باشد.
– ورود راحت و خودکار
معایب:
– تاییدیه کم
– نسبت ریوارد به ریسک پایین درصورتی که ناحیه در تایم‌فریم پایین‌تر بهینه نشده باشد.


جریان سفارشات تایم‌فریم بالاتر و ورود در تایم‌فریم پایین‌تر
جریان سفارشات تایم‌فریم بالاتر
قوی
ضعیف
شکست جریان سفارشات مورد انتظار
فلیپ + CHoCH
ضعیف
قوی
ورود در تایم‌فریم پایین‌تر

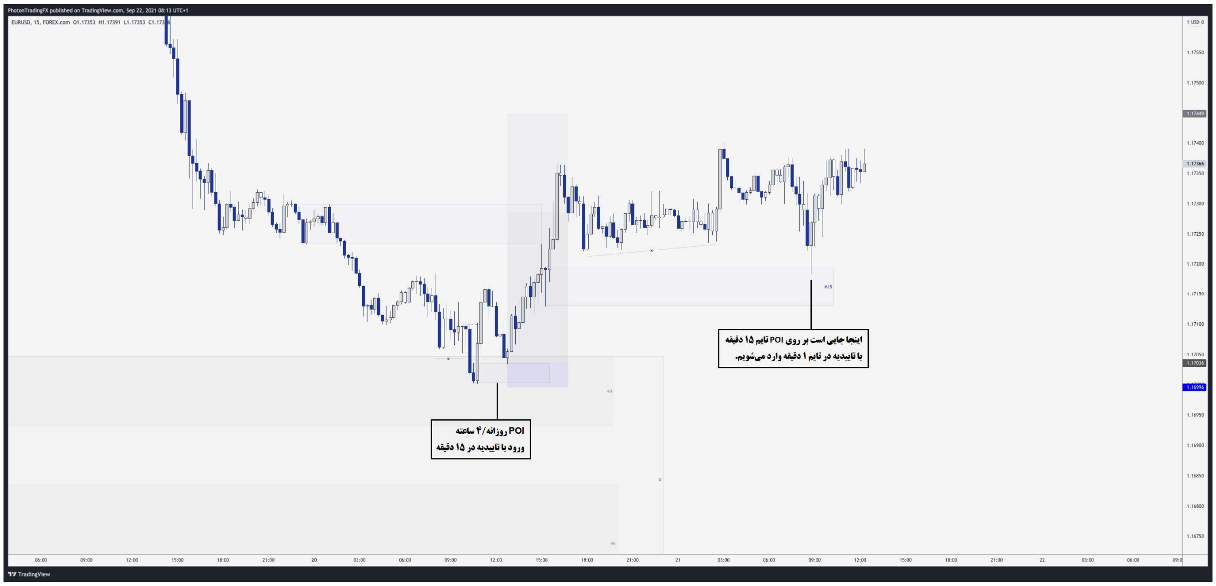


مثال واقعی:

۴ ساعته



۱۵ دقیقه



۱ دقیقه



مدیریت معاملات

اگر قبل از ورود نمی‌دانید که دقیقا **چطور** و **کجا** باید **خارج** شوید، نباید وارد آن ترید شوید. شما باید یک برنامه بسیار واضح و مکانیکی برای مدیریت تریدهایتان داشته باشید تا بتوانید آن را برای هر ترید تکرار کنید.

مدیریت ترید ← به هر برنامه‌ای که طی آن یک معامله‌گر بعد از باز کردن ترید به منظور به حداقل رساندن ریسک و حداکثر رساندن سود انجام می‌دهد می‌گویند.

مدیریت معاملات تاثیر قابل توجهی بر روی نرخ برد و میانگین سود شما دارد.

سه ابزار برای مدیریت یک ترید

۱. برداشت کامل سود

یک تارگت برای پوزیشن باز تعیین می‌شود تا در یک قیمت خاص کل پوزیشن بسته شود.

مزایا:

- قرار دادن سفارش و انتظار برای نتیجه (Set & Forget)
- گرفتن حداکثر سود در تریدهای با سود زیاد

معایب:

- احتمال از دست رفتن کل سودِ به‌دست آمده
- ریسک پوشش داده نمی‌شود (مگر آنکه استاپ‌لاس تریل شود)

۲. خروجِ بخشی

تعیین چند تارگت برای یک ترید و بستن بخشی از حجم پوزیشن در هر تارگت.

مزایا:

- قرار دادن سفارش و انتظار برای نتیجه (Set & Forget)
- برداشت سود در مسیر رسیدن به تارگت نهایی
- آرامش روانی
- ریسک پوشش داده می‌شود و امکان ورود در اصلاح‌ها بوجود می‌آید.

معایب:

- در تریدهای خوب (قیمت حرکت زیادی در سود داشته) حجم کمی باقی‌مانده است.
- ریسک ورود و اجرای بیش‌تر (برای هر پوزیشن تریدهای بیشتری باید باز شود)

۳. تِریل استاپ‌لاس

به حرکت دادن استاپ‌لاس و انتقال آن به پشت نواحی مهم قیمت تریل می‌گویند.

مزایا:

- با نگه داشتن کل حجم پوزیشن ریسک پوشش داده می‌شود.
- خروج در مواقع شکست جریان سفارشات مورد انتظار (تغییر روند)

معایب:

- استاپ خوردن زودهنگام در زمان جمع‌آوری نقدینگی
- مدیریت فعال (همیشه باید پای چارت باشید)

تارگت‌ها

۱. ریوارد ثابت

تنظیم تارگت بر اساس مقدار سود از پیش تعیین شده، برای مثال خروج کامل در نسبت ریوارد به ریسک ۱۰.

۲. تارگت‌ها تکنیکالی

تنظیم تارگت بر اساس سطوح مهم قیمت:

- نواحی عرضه و تقاضا
- ساختار (نقدینگی)

از خودتان بپرسید که قیمت احتمالا در کجا پولبک می‌زند یا بازمی‌گردد؟

می‌توانید از ترکیب هر دو روش بالا استفاده کنید:

برای مثال از ریوارد ثابت برای خارج کردن میزان ریسک ترید استفاده کنید و از تارگت‌های تکنیکالی برای خرج بخشیِ حجم باقی‌مانده استفاده کنید (بستن ۲۰ درصد از پوزیشن در ریوارد ۴ و بستن ۸۰ درصد باقی‌مانده در سوییngگ سقف/کف ضعیف).

استفاده از خروج بخشی برای سربه‌سر کردن

خروج بخشی اجازه می‌دهد تا بدون دست زدن به پوزیشن ریسک را حذف کنید (در مقایسه با تریل استاپ‌لاس).

برای مثال خروج ۲۰ از حجم پوزیشن در ریوارد ۴ برای پوشش ریسک.

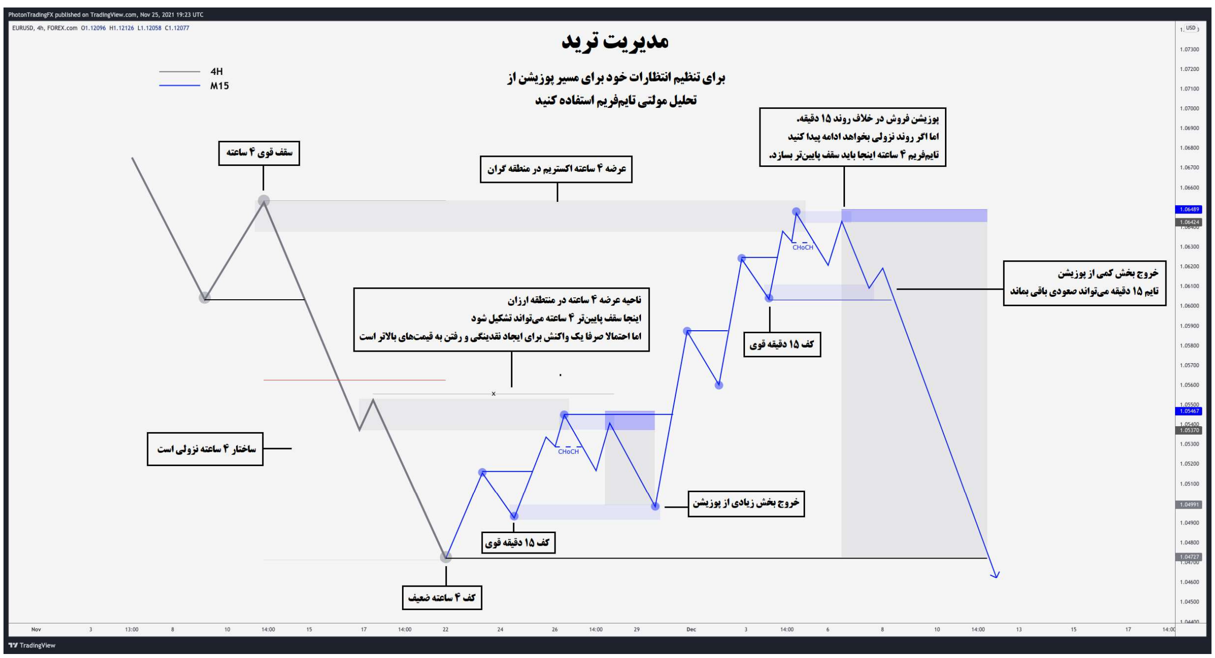
استاپ‌های کوچک می‌تواند کمیسیون را افزایش دهد، به همین دلیل می‌توانید بخش بیش‌تری را در ریوارد ۴ ببندید، برای مثال ۲۵ درصد از پوزیشن را در ریوارد ۴ ببندید.

نکات کلیدی

- هیچ قانون واحدی وجود ندارد که مناسب همه باشد و مدیریت ترید برای هر کسی متفاوت است.
- ببینید که کدام حالت با استراتژی / روانشناسی / استایل زندگی شما همخوانی بیش‌تری دارد.
- قوانین را ساده و مکانیکی نگه دارید و همیشه به همان طریق ریسک را حذف کنید.
- تست بگیرید، تست بگیرید، تست بگیرید!

مثال‌های مدیریت ترید





فصل پنجم:

جمع‌بندی مطالب

داستان تایم‌فریم بالاتر و انتخاب POI

در زمان تحلیل چارت، بازار را از چپ به سمت راست بخوانید.

این کار باعث می‌شود به دلیل زوم شدن در حرکات فعلی قیمت اطلاعات مهم را از دست ندهید.

قیمت چه کاری انجام داده است؟

قیمت هم‌اکنون در چه رنج سویینگی است؟

سقف‌ها/کف‌های قوی (محافظت شده) کجا هستند؟

سقف‌ها/کف‌های ضعیف (تارگت) کجا هستند؟

مصرف شدن‌ها در کجا رخ داده است (زنجیره‌های عرضه و تقاضا را دنبال کنید)

مسیر با کم‌ترین مقاومت کجاست؟

چگونه POIهای با احتمال برد بالا برای ترید در تایم‌فریم پایین انتخاب کنیم؟

مجموعه‌ای از عوامل به ما کمک می‌کند تا POI خوب یا بد را بررسی کنیم (آماری)، عوامل زیر برخی از آن‌ها هستند:

- ساختار مولی تایم‌فریم و جریان سفارشات مورد انتظار
- منطقه ارزان و گرانِ ساختار سویینگ و داخلی در تایم‌فریم بالاتر و میانی
- نقدینگی تایم‌فریم بالاتر و میانی (القا)
- نواحی ساختاری - هرچه ناحیه، ساختار مهم‌تری را شکسته باشد، آن ناحیه مهم‌تر است.
- نواحی فلیپ – آیا عرضه/تقاضا به طرف مقابل غلبه کرده است؟
- نواحی جمع‌آوری نقدینگی – آیا خود ناحیه نقدینگی جمع‌آوری کرده بوده؟
- آیا ناحیه یک سقف/کف قوی است و یک سقف/کف ضعیف برای تارگت دارد؟ یا انتظار دارید شکسته شود؟

نکته POIها این است که احتمال دارد واضح‌ترین آن‌ها کاملا شکست بخورد و آن که بدترین به نظر می‌رسد جواب دهد. این طبیعت و ماهیت معامله‌گری است. شما به تحلیل تکنیکال یا مهارتی نیاز ندارید که هر کدام از تریدهایتان برنده باشد، اما برای استمرار در بلند مدت و تبدیل شدن به تریدر سودده بایستی طبق برنامه پیش بروید. برای شناسایی POIها هم همین مسئله برقرار است.

مهارت تحلیل تایم‌فریم بالا و میانی را تمرین کنید، زیرا مهارت بسیار بالایی در تعیین سطوح درست به شما خواهد داد.

ترید بر خلاف روند تایم‌فریم بالاتر

در این درس، من داستان تایم‌فریم بالاتر را با تمرکز بسیار بر روی شناسایی ساختار سویینگ و داخلی ساختم. همچنین نحوه انتخاب POIها را پوشش دادم تا در زمان ترید در خلاف روند تایم‌فریم بالاتر بتوانید نرخ بردتان را تا جای ممکن بالا نگه دارید. در ادامه به نکات کلیدی قبل چند مورد اضافه می‌کنم.

چگونه POIهای با احتمال برد بالا برای ترید در تایم‌فریم پایین انتخاب کنیم؟ (قسمت ۲)

- داستان کلی تایم‌فریم بالاتر چیست؟ (در جهت/خلاف روند، چند تایم‌فریم در یک راستا هستند؟)
- POI تایم‌فریم ۱۵ دقیقه چگونه قیمت‌گذاری شده است؟ (نسبت به منطقه ارزان/گران تایم‌فریم ۱۵ دقیقه و ۴ ساعته)
- POI تایم‌فریم ۱۵ دقیقه چه کاری انجام داده است؟ (شکست ساختار / فلیپ / هر دو)
- آیا POI تایم‌فریم ۱۵ دقیقه یک ناحیه جمع‌آوری نقدینگی بوده است؟ (در زمان تشکیل نقدینگی جمع‌آوری کرده بوده؟)
- آیا القای ساختاری در مقابل POI تایم‌فریم ۱۵ دقیقه وجود دارد؟ (در غیر این صورت خود ناحیه POI می‌تواند القا باشد)
- آیا با ناحیه دیگری هم‌پوشانی دارد؟ (ناحیه ۱۵ دقیقه درون ناحیه ۴ ساعته)
- آیا POI تایم‌فریم ۱۵ دقیقه یک ناحیه رنج است یا پیوت؟ (هر چقدر ناحیه بهینه‌تر باشد، ورود در ۱ دقیقه احتمال برد بیش‌تری دارد. نواحی رنج می‌توانند قبل از حرکت اصلی فریب دهند؛ بنابراین می‌توانید ابتدا از ناحیه رنج منتظر CHoCH در تایم‌فریم ۱۵ دقیقه باشید.)
- قیمت چگونه به ناحیه رسیده است؟ (قوی یا اصلاحی)

به‌منظور ساده‌تر کردن، برای افزایش نرخ برد در ورودهای تایم‌فریم ۱ دقیقه بر روی نواحی POI تایم‌فریم ۱۵ دقیقه ۲ مورد اصلی زیر را مد نظر قرار دهید:

۱. جمع‌آوری نقدینگی ← اولین CHoCH در تایم‌فریم ۱ دقیقه بر روی POI تایم‌فریم ۱۵ دقیقه می‌تواند فریب باشد، برای همین منتظر جمع‌آوری نقدینگی می‌مانیم.

۲. مصرف شدن ناحیه بهینه‌شده ۱ دقیقه درون POI تایم‌فریم ۱۵ دقیقه ← افزایش دقت و زمان‌بندی

اگر بعد از برخورد به هر POI رندوم در CHoCH تایم‌فریم ۱ دقیقه ورود کنید نرخ برد شما بسیار پایین می‌آید. به همین دلیل ما با کمک نکات بالا POIهای با احتمال برد بالا را انتخاب می‌کنیم.

همچنین مدل ورود به این صورت است:

ایجاد و جمع‌آوری نقدینگی ← مصرف شدن ← CHoCH ← فلیپ (جمع‌آوری نقدینگی) ← ورود

به جای مدل مصرف شدن ← CHoCH ← ورود، از مدل بالا استفاده کنید.

بنابراین موارد بالا سوالاتی هستند که من دائما قبل فکر کردن به ورود از خودم می‌پرسم.

زمانی که شروع کردید می‌توانید از قوانین ساده و مکانیکی مانند زیر پیروی کنید:

POI ۴ ساعته ← انتظار برای CHoCH در ۱۵ دقیقه

POI ۱۵ دقیقه ← انتظار برای CHoCH در ۱ دقیقه

ناحیه ۱۵ دقیقه درون POI ۴ ساعته ← انتظار برای CHoCH در ۱ دقیقه

شما می‌توانید این قوانین را بسته به در جهت روند یا خلاف جهت روند تایم‌فریمی خاص تنظیم کنید، اما سعی کنید ساده نگه دارید.

این کتابچه به صورت کامل توسط آکادمی ترید برای زندگی به رایگان ترجمه و در اختیار شما عزیزان قرار گرفته است. همچنین می‌توانید برای مشاهده مطالب دیگر و تکمیلی به کانال تلگرام ما مراجعه نمایید:

https://t.me/TFLacademy

در صورت تمایل می‌توانید از طریق لینک زیر ما را حمایت کنید.
دونیت یا حمایت‌های مالی اختیاری و لطف شماست. تنها حضور و پیام‌های دلگرم کننده شما انگیزه کار ماست.
از حمایت شما بی‌نهایت سپاس‌گزاریم.

https://idpay.ir/tflacademy